

融通深证成份指数证券投资基金 2019 年半年度报告

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 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据融通深证成份指数证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同规定，于 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 ...	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16

6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告.....	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	56
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	56
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	56
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	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	57
§ 8 基金份额持有人信息.....	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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	58
§ 9 开放式基金份额变动.....	59
§ 10 重大事件揭示.....	59
10.1 基金份额持有人大会决议	59
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	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
10.4 基金投资策略的改变	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
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	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8 其他重大事件	62
§ 11 备查文件目录.....	64
11.1 备查文件目录	64

11.2 存放地点	64
11.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	融通深证成份指数证券投资基金	
基金简称	融通深证成份指数	
基金主代码	161612	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010 年 11 月 15 日	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	170,329,362.51 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	融通深证成份指数 A/B	融通深证成份指数 C
下属分级基金的交易代码	161612	004875
下属分级基金的前端交易代码	161612	004875
下属分级基金的后端交易代码	161662	-
报告期末下属分级基金的份额总额	164,672,964.75 份	5,656,397.76 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

	大厦 13、14 层	号
邮政编码	518053	100140
法定代表人	高峰	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	融通基金管理有限公司	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)	
	融通深证成份指数 A/B	融通深证成份指数 C
本期已实现收益	-3,374,674.66	-90,905.56
本期利润	29,115,229.35	382,172.11
加权平均基金份额本期利润	0.1772	0.0837
本期加权平均净值利润率	23.01%	10.68%
本期基金份额净值增长率	28.04%	27.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-33,031,062.91	-1,553,932.97
期末可供分配基金份额利润	-0.2006	-0.2747
期末基金资产净值	131,641,901.84	4,462,634.23
期末基金份额净值	0.799	0.789
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-19.09%	-8.79%

注：(1) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

(2) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

(3) 期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配

利润（已实现部分扣除未实现部分）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

融通深证成份指数 A/B

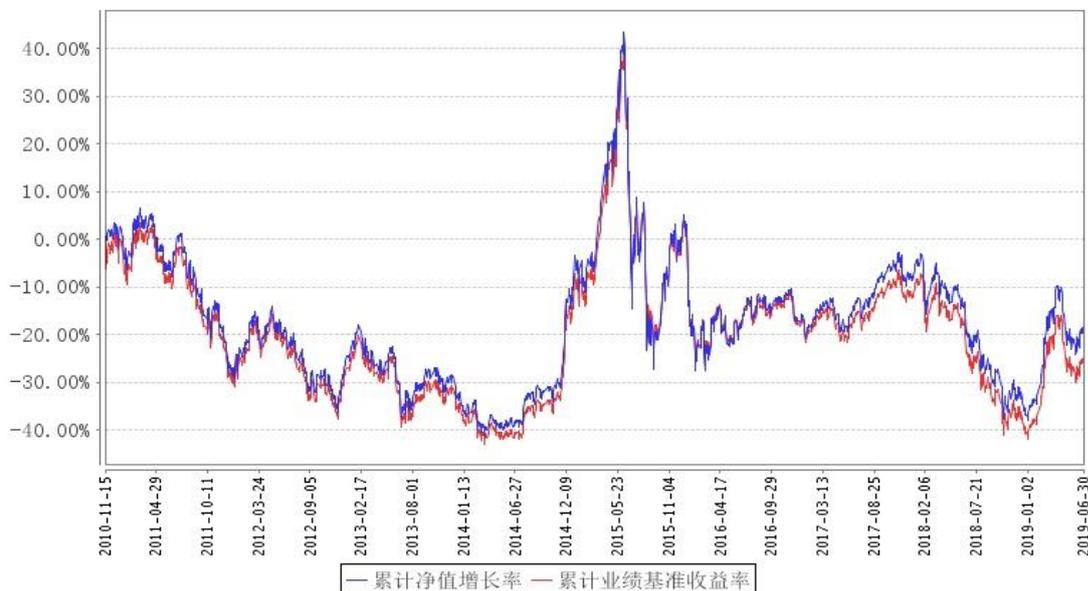
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.23%	1.30%	2.73%	1.31%	0.50%	-0.01%
过去三个月	-5.56%	1.75%	-6.95%	1.74%	1.39%	0.01%
过去六个月	28.04%	1.71%	25.41%	1.71%	2.63%	0.00%
过去一年	1.01%	1.65%	-1.85%	1.64%	2.86%	0.01%
过去三年	-3.73%	1.24%	-11.61%	1.24%	7.88%	0.00%
自基金合同生效起至今	-19.09%	1.59%	-25.57%	1.55%	6.48%	0.04%

融通深证成份指数 C

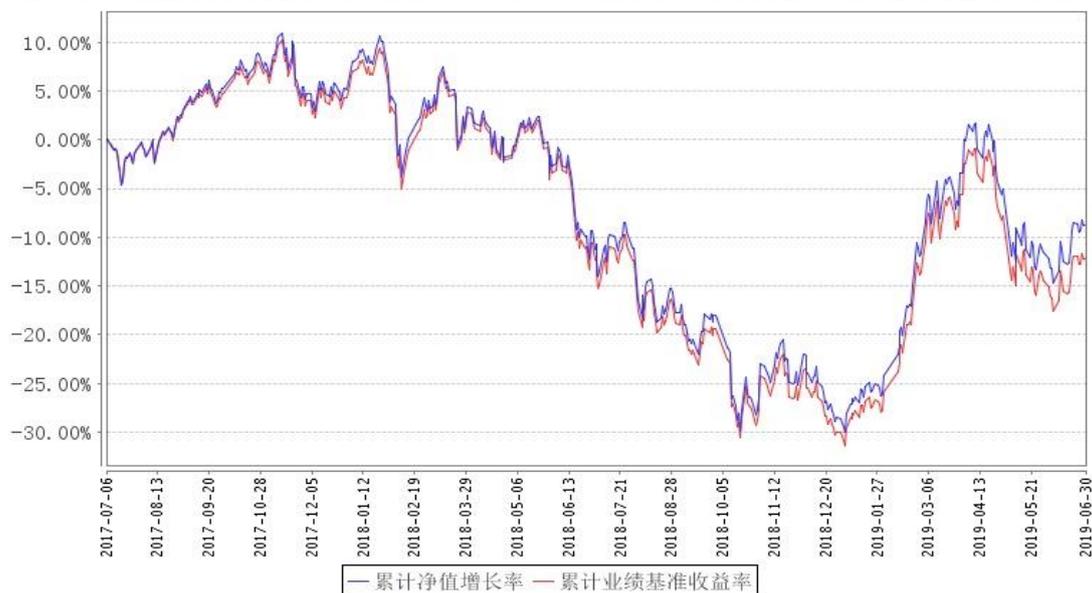
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.27%	1.31%	2.73%	1.31%	0.54%	0.00%
过去三个月	-5.62%	1.76%	-6.95%	1.74%	1.33%	0.02%
过去六个月	27.88%	1.71%	25.41%	1.71%	2.47%	0.00%
过去一年	0.64%	1.65%	-1.85%	1.64%	2.49%	0.01%
自基金合同生效起至今	-8.79%	1.40%	-12.23%	1.40%	3.44%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

融通深证成份指数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



融通深证成份指数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 日增设 C 类份额，本基金 C 类份额的统计区间为 2017 年 7 月 6 日至本报告期末。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

融通基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证监会证监基字[2001]8号文批准，于2001年5月22日成立，公司注册资本12500万元人民币。本公司的股东及其出资比例为：新时代证券股份有限公司60%、日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co., Ltd.）40%。

截至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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蔡志伟	本基金的基金经理	2016 年 11 月 19 日	-	8	蔡志伟先生，计算机应用技术硕士，金融风险管理师（FRM），8 年证券投资从业经历，具有基金从业资格。2006 年 7 月至 2008 年 8 月就职于汇丰软件开发（广东）有限公司任高级软件工程师。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 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理、融通深证成份指数证券投资基金基金经理、融通创业板指数增强型证券投资基金基金经理。

注：任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写；证券从业年限以从事证券业务相关工作的时间为计算标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则，在授权、研究分析、投资决策、

交易执行、业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。

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

报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通深证成份指数 A/B 基金份额净值为 0.799 元，本报告期基金份额净值增长率为 28.04%；截至本报告期末融通深证成份指数 C 基金份额净值为 0.789 元，本报告期基金份额净值增长率为 27.88%；同期业绩比较基准收益率为 25.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年上半年全球经济延续下行趋势，直接导致了全球央行态度再度转向宽松。目前看，全球经济仍未见到复苏信号，尽管中美贸易冲突短期有所缓和，但不确定性依然存在，预计外需的疲弱和外部因素对出口仍将造成压力。

从国内宏观经济来看，上半年需求端总体偏弱，宏观经济基本面继续寻底。出口进入下行周期，但衰退型顺差提升了净出口对 GDP 贡献；固定资产投资整体平稳，预计下半年基建将发力，成为稳内需的关键，而消费预计在政策作用下将有所改善。货币政策方面，宽货币和宽信用仍然是主基调。总体而言 2019 年下半年经济仍在寻底，但政策对冲下行压力，预计宏观经济总体平稳。

虽然上半年市场在流动性、政策、外部因素改善下市场迎来一定幅度的反弹，但当前市场仍处于长期底部区域。从市场估值角度看，目前估值处于 A 股历史较低水平，且结构较优。而从全球股市对比来看，A 股市盈率仍处于全球较低水平，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 年可能增速较 2018 年有所回落，预计 3 季度盈利增速探底，4 季度开始回升，全年可能是个位数增长。而从市场流动性的角度看，2019 年流动性边际改善，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。

总的来看, 2019 年下半年 A 股市场机会仍大于风险。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、网络安全和芯片将长期受益。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、地产和公用事业, 相信相关行业也将有较好的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内, 本基金的估值业务严格按照《融通基金管理有限公司证券投资基金估值业务原则和程序》进行, 公司设立由研究部、风险管理部、登记清算部、固定收益部、国际业务部和监察稽核部共同组成的估值委员会, 通过参考行业协会估值意见、参考独立第三方估值服务机构的估值数据等一种或多种方式的有效结合, 减少或避免估值偏差的发生。估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。

估值委员会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应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

本基金本报告期内未进行利润分配, 符合法律法规和基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内, 本基金托管人在对融通深证成份指数证券投资基金的托管过程中, 严格遵守《证

券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，融通深证成份指数证券投资基金的管理人——融通基金管理有限公司在融通深证成份指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，融通深证成份指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,572,496.82	924,526.73
结算备付金		91,118.27	9,279.58
存出保证金		5,277.12	3,441.15
交易性金融资产	6.4.7.2	133,088,981.30	103,842,543.52
其中：股票投资		128,578,281.38	98,824,143.52
基金投资		-	-
债券投资		4,510,699.92	5,018,400.00
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		2,017,999.30	-
应收利息	6.4.7.5	80,879.87	143,032.21
应收股利		-	-
应收申购款		84,606.97	60,870.31
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		137,941,359.65	104,983,693.50
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018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		-	356,768.41
应付赎回款		1,558,894.66	200,171.78
应付管理人报酬		110,069.21	91,928.39
应付托管费		22,013.83	18,385.69
应付销售服务费		1,587.03	314.47
应付交易费用	6.4.7.7	62,113.21	16,517.39
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	82,145.64	40,157.57
负债合计		1,836,823.58	724,243.70
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	170,329,362.51	167,035,350.31
未分配利润	6.4.7.10	-34,224,826.44	-62,775,900.51
所有者权益合计		136,104,536.07	104,259,449.80
负债和所有者权益总计		137,941,359.65	104,983,693.50

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 170,329,362.51 份，其中融通深证成份指数 A/B 基金份额总额为 164,672,964.75 份，基金份额净值 0.799 元；融通深证成份指数 C 基金份额总额为 5,656,397.76 份，基金份额净值 0.789 元。

6.2 利润表

会计主体：融通深证成份指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	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
一、收入		30,500,990.59	-17,892,554.67
1. 利息收入		77,693.62	59,601.27
其中：存款利息收入	6.4.7.11	11,438.85	19,171.13
债券利息收入		66,254.77	40,430.14
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		-2,617,782.28	-8,007,344.08
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-3,778,764.25	-8,845,420.57
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	35,697.16	47,045.61
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,125,284.81	791,030.88
3. 公允价值变动收益	6.4.7.17	32,962,981.68	-9,952,258.60
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	6.4.7.18	78,097.57	7,446.74
减：二、费用		1,003,589.13	978,815.98
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	641,963.31	699,258.59
2. 托管费	6.4.10.2.2	128,392.58	139,851.68
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	6,965.28	95.45

4. 交易费用	6.4.7.19	148,960.24	70,041.86
5. 利息支出		23.62	-
其中：卖出回购金融资产支出		23.62	-
6. 税金及附加		0.02	0.04
7. 其他费用	6.4.7.20	77,284.08	69,568.36
三、利润总额		29,497,401.46	-18,871,370.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润		29,497,401.46	-18,871,370.65

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通深证成份指数证券投资基金

本报告期：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）	167,035,350.31	-62,775,900.51	104,259,449.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	29,497,401.46	29,497,401.46
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	3,294,012.20	-946,327.39	2,347,684.81
其中：1. 基金申购款	49,372,124.91	-10,230,064.82	39,142,060.09
2. 基金赎回款	-46,078,112.71	9,283,737.43	-36,794,375.28
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）	170,329,362.51	-34,224,826.44	136,104,536.07
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）	169,157,334.19	-14,962,731.37	154,194,602.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-18,871,370.65	-18,871,370.65
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-10,737,768.68	700,234.39	-10,037,534.29

其中：1. 基金申购款	10,189,083.15	-1,212,219.38	8,976,863.77
2. 基金赎回款	-20,926,851.83	1,912,453.77	-19,014,398.06
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	158,419,565.51	-33,133,867.63	125,285,697.88

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<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

融通深证成份指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]606号《关于核准融通深证成份指数证券投资基金募集的批复》核准,由融通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通深证成份指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,848,674,651.50元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第315号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《融通深证成份指数证券投资基金基金合同》于2010年11月15日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,848,841,553.44份基金份额,其中认购资金利息折合166,901.94份基金份额。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人于2017年7月5日发布的《融通基金管理有限公司关于融通深证成份指数证券投资基金增设C类基金份额并修订基金合同部分条款的公告》,自2017年7月5日起对本基金进行份额分类,原有基金份额为A/B类份额,增设C类份额。在投资者申购时收取前端申购费用的份额,称为A类份额;在投资者赎回时收取后端申购费用的份额,称为B类份额;不收取申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费并按照持有期限收取赎回费的份额,称为C类份额。本基金分类后,本基金原有基金份额将自动划归为本基金A/B类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通深证成份指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括深证成份指数的成份股与备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金力求将净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%以内,以实现深证成份指数的有效跟踪。本基金标的指数使用费由基金管理人融通基金管理有

限公司承担，不计入本基金费用。本基金投资于指数成份股与备选成份股的资产不低于股票资产的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：深证成份指数收益率 X 95%+银行活期存款利率 X 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《融通深证成份指数证券投资基金 基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，

不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	2,572,496.82
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	2,572,496.82

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	141,590,638.28	128,578,281.38	-13,012,356.90
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	4,515,999.92	4,510,699.92
	银行间市场	-	-
	合计	4,515,999.92	4,510,699.92
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	146,106,638.20	133,088,981.30	-13,017,656.90

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	486.88
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	36.90
应收债券利息	80,354.02
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-

其他	2.07
合计	80,879.87

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	62,113.21
银行间市场应付交易费用	-
合计	62,113.21

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,987.56
预提费用	77,158.08
合计	82,145.64

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

融通深证成份指数 A/B		
项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	165,371,428.39	165,371,428.39
本期申购	30,986,987.51	30,986,987.51
本期赎回(以“-”号填列)	-31,685,451.15	-31,685,451.15
本期末	164,672,964.75	164,672,964.75

融通深证成份指数 C	
项目	本期

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	1,663,921.92	1,663,921.92
本期申购	18,385,137.40	18,385,137.40
本期赎回 (以“-”号填列)	-14,392,661.56	-14,392,661.56
本期末	5,656,397.76	5,656,397.76

注:申购含转换入份额;赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位:人民币元

融通深证成份指数 A/B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	37,368,472.20	-99,507,817.66	-62,139,345.46
本期利润	-3,374,674.66	32,489,904.01	29,115,229.35
本期基金份额交易产生的变动数	-95,153.13	88,206.33	-6,946.80
其中:基金申购款	6,666,087.46	-13,082,332.26	-6,416,244.80
基金赎回款	-6,761,240.59	13,170,538.59	6,409,298.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	33,898,644.41	-66,929,707.32	-33,031,062.91

融通深证成份指数 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-421,263.24	-215,291.81	-636,555.05
本期利润	-90,905.56	473,077.67	382,172.11
本期基金份额交易产生的变动数	-1,041,764.17	102,383.58	-939,380.59
其中:基金申购款	-4,872,139.62	1,058,319.60	-3,813,820.02
基金赎回款	3,830,375.45	-955,936.02	2,874,439.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,553,932.97	360,169.44	-1,193,763.53

6.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	10,767.51
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	639.13
其他	32.21
合计	11,438.85

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	49,990,516.95
减：卖出股票成本总额	53,769,281.20
买卖股票差价收入	-3,778,764.25

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	5,536,742.34
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	5,315,998.36
减：应收利息总额	185,046.82
买卖债券差价收入	35,697.16

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,125,284.81
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,125,284.81

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	32,962,981.68
股票投资	32,981,481.68
债券投资	-18,500.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
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	32,962,981.68

6.4.7.18 其他收入

单位:人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	76,553.44
基金转换费收入	1,544.13
合计	78,097.57

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

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

6.4.7.19 交易费用

单位:人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	148,960.24
银行间市场交易费用	-
合计	148,960.24

6.4.7.20 其他费用

单位:人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	57,322.29
银行费用	126.00

合计	77,284.08
----	-----------

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截止资产负债表日，本基金无需作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
融通基金管理有限公司（“融通基金”）	基金管理人、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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未租用关联方的交易单元。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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
当期发生的基金应支付的管理费	641,963.31	699,258.59
其中：支付销售机构的客户维护费	266,883.07	289,769.79

注：1. 支付基金管理人融通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	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	128,392.58	139,851.68

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	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		
	融通深证成份指数 A/B	融通深证成份指数 C	合计
融通基金	-	113.56	113.56
合计	-	113.56	113.56
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		
	融通深证成份指数 A/B	融通深证成份指数 C	合计
融通基金	-	95.45	95.45
合计	-	95.45	95.45

注：本基金 A/B 类份额不收取销售服务费；

支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计

至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

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

无。

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

无。

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	
	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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	2,572,496.82	10,767.51	2,064,842.75	18,986.20

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

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2019 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	期末成本总额	期末估值总额	备注

							位： 股)			
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	-

金额单位：人民币元

6.4.12.1.2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 (单 位： 张)	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
128068	和 而 转 债	2019-6-4	2019-7-1	新 债 流 通 受 限	100.00	100.00	89	8,899.92	8,899.92	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金。本基金主要投资于标的指数的成份股与备选成份股。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行内控优先和全员风险管理理念，高度重视风险管理的组织保障和制

度保障，建立了完备的风险管理组织及相应的制度和流程，力争在风险最小化的前提下，确保基金份额持有人利益最大化。

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

公司管理层对有效的风险管理承担直接责任，根据董事会的风险管理战略，制定与公司发展战略、整体风险承受能力相匹配的风险管理制度，并确保风险管理制度得以全面、有效执行。在公司管理层下设立风险管理委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和个业务单元开展风险管理工作；制定相关风险控制政策，审批风险管理重要流程和风险限额，并与公司整体业务发展战略和风险承受能力相一致；识别公司各项业务所涉及各类重大风险，对重大风险、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，制定重大风险的解决方案；识别和评估新产品、新业务的新增风险，并制定控制措施；重点关注内控机制薄弱环节和那些可能给公司带来重大损失的事件，提出控制措施和解决方案；协调突发性重大风险事件的处理；审定风险事件责任人的责任；根据公司风险管理总体策略和各职能部门与业务单元职责分工，组织实施风险应对方案。

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

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

监察稽核部负责监察公司各业务部门在相关法律法规、规章制度和业务流程执行方面的情况，确保既定的风险管理措施得到有效的贯彻执行，发现内控缺失和管理漏洞，提出改进要求和建议，并报告法规和制度的执行情况。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；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 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.01%（2018 年 12 月 31 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）。

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 2019 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中

度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，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%（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上述比例限制）。

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。截止 2019 年 6 月 30 日，本基金最后交易日的组合资产中 7 个工作日可变现资产账面金额与净赎回金额符合上述法规要求。

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。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面

临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,572,496.82	-	-	-	2,572,496.82
结算备付金	91,118.27	-	-	-	91,118.27
存出保证金	5,277.12	-	-	-	5,277.12
交易性金融资产	4,501,800.00	8,899.92	-	128,578,281.38	133,088,981.30
应收利息	-	-	-	80,879.87	80,879.87
应收申购款	-	-	-	84,606.97	84,606.97
应收证券清算款	-	-	-	2,017,999.30	2,017,999.30
资产总计	7,170,692.21	8,899.92	-	130,761,767.52	137,941,359.65
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,558,894.66	1,558,894.66
应付管理人报酬	-	-	-	110,069.21	110,069.21
应付托管费	-	-	-	22,013.83	22,013.83
应付销售服务费	-	-	-	1,587.03	1,587.03
应付交易费用	-	-	-	62,113.21	62,113.21
其他负债	-	-	-	82,145.64	82,145.64
负债总计	-	-	-	1,836,823.58	1,836,823.58
利率敏感度缺口	7,170,692.21	8,899.92	-	128,924,943.94	136,104,536.07
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2018 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	924,526.73	-	-	-	924,526.73
结算备付金	9,279.58	-	-	-	9,279.58
存出保证金	3,441.15	-	-	-	3,441.15
交易性金融资产	5,018,400.00	-	-	98,824,143.52	103,842,543.52
应收利息	-	-	-	143,032.21	143,032.21
应收申购款	-	-	-	60,870.31	60,870.31
资产总计	5,955,647.46	-	-	99,028,046.04	104,983,693.50
负债					
应付证券清算款	-	-	-	356,768.41	356,768.41
应付赎回款	-	-	-	200,171.78	200,171.78
应付管理人报酬	-	-	-	91,928.39	91,928.39
应付托管费	-	-	-	18,385.69	18,385.69
应付销售服务费	-	-	-	314.47	314.47
应付交易费用	-	-	-	16,517.39	16,517.39
其他负债	-	-	-	40,157.57	40,157.57
负债总计	-	-	-	724,243.70	724,243.70
利率敏感度缺口	5,955,647.46	-	-	98,303,802.34	104,259,449.80

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 3.31% (2018 年 12 月 31 日：4.81%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2018 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，其中投资深证成份指数成份股及其备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；并保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	128,578,281.38	94.47	98,824,143.52	94.79
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	128,578,281.38	94.47	98,824,143.52	94.79

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除深证成份指数收益率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2019年6月30日）	上年度末 （2018年12月31日）
	深证成份指数收益率 上升 5%	6,449,539.85	4,978,863.32
深证成份指数收益率 下降 5%	-6,449,539.85	-4,978,863.32	

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	128,578,281.38	93.21
	其中：股票	128,578,281.38	93.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,510,699.92	3.27
	其中：债券	4,510,699.92	3.27
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,663,615.09	1.93
8	其他各项资产	2,188,763.26	1.59
9	合计	137,941,359.65	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

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	4,405,357.88	3.24
B	采矿业	1,494,462.23	1.10
C	制造业	80,219,904.45	58.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,263,591.00	0.93
E	建筑业	905,483.45	0.67
F	批发和零售业	2,539,558.77	1.87
G	交通运输、仓储和邮政业	1,158,956.07	0.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,797,001.82	9.40
J	金融业	9,112,619.17	6.70
K	房地产业	7,044,796.66	5.18
L	租赁和商务服务业	1,928,646.94	1.42
M	科学研究和技术服务业	452,130.00	0.33
N	水利、环境和公共设施管理业	706,419.50	0.52
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	81,007.00	0.06
Q	卫生和社会工作	2,175,193.29	1.60
R	文化、体育和娱乐业	1,705,898.94	1.25
S	综合	212,983.00	0.16
	合计	128,204,010.17	94.20

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

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	31,445.00	0.02

B	采矿业	-	-
C	制造业	209,778.11	0.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	109,941.50	0.08
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.02
S	综合	-	-
	合计	374,271.21	0.27

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	89,702	4,933,610.00	3.62
2	000333	美的集团	94,703	4,911,297.58	3.61
3	000858	五粮液	33,205	3,916,529.75	2.88
4	300498	温氏股份	86,148	3,089,267.28	2.27
5	000002	万科A	94,700	2,633,607.00	1.93
6	000001	平安银行	163,609	2,254,532.02	1.66

7	002415	海康威视	67,335	1,857,099.30	1.36
8	000725	京东方 A	515,598	1,773,657.12	1.30
9	000063	中兴通讯	46,577	1,515,149.81	1.11
10	002304	洋河股份	10,735	1,304,946.60	0.96
11	300059	东方财富	96,305	1,304,932.75	0.96
12	000568	泸州老窖	15,443	1,248,257.69	0.92
13	000338	潍柴动力	100,240	1,231,949.60	0.91
14	002475	立讯精密	49,650	1,230,823.50	0.90
15	002027	分众传媒	223,664	1,183,182.56	0.87
16	002142	宁波银行	45,694	1,107,622.56	0.81
17	000661	长春高新	2,997	1,012,986.00	0.74
18	001979	招商蛇口	48,063	1,004,516.70	0.74
19	002230	科大讯飞	28,063	932,814.12	0.69
20	000876	新希望	53,200	924,084.00	0.68
21	300750	宁德时代	13,400	922,992.00	0.68
22	000166	申万宏源	183,120	917,431.20	0.67
23	000776	广发证券	66,560	914,534.40	0.67
24	002594	比亚迪	16,644	844,183.68	0.62
25	300015	爱尔眼科	26,897	833,000.09	0.61
26	002714	牧原股份	14,140	831,290.60	0.61
27	002024	苏宁易购	67,705	777,253.40	0.57
28	000538	云南白药	8,642	720,915.64	0.53
29	000100	TCL 集团	213,920	712,353.60	0.52
30	300142	沃森生物	23,600	669,296.00	0.49
31	002008	大族激光	17,800	611,964.00	0.45
32	000783	长江证券	77,725	607,032.25	0.45
33	002202	金风科技	48,288	600,219.84	0.44
34	002007	华兰生物	19,350	589,981.50	0.43

35	002410	广联达	17,762	584,192.18	0.43
36	002044	美年健康	46,380	576,967.20	0.42
37	000069	华侨城 A	80,044	556,305.80	0.41
38	000157	中联重科	91,141	547,757.41	0.40
39	300017	网宿科技	49,343	531,917.54	0.39
40	300003	乐普医疗	23,100	531,762.00	0.39
41	002736	国信证券	40,400	531,664.00	0.39
42	000963	华东医药	20,091	521,562.36	0.38
43	002422	科伦药业	17,316	514,804.68	0.38
44	300124	汇川技术	22,198	508,556.18	0.37
45	000895	双汇发展	20,017	498,223.13	0.37
46	002463	沪电股份	36,400	495,768.00	0.36
47	300024	机器人	32,525	495,355.75	0.36
48	300347	泰格医药	6,300	485,730.00	0.36
49	002049	紫光国微	10,900	480,799.00	0.35
50	002460	赣锋锂业	20,450	479,143.50	0.35
51	002195	二三四五	120,018	466,870.02	0.34
52	002179	中航光电	13,842	463,153.32	0.34
53	002236	大华股份	31,864	462,665.28	0.34
54	300033	同花顺	4,600	452,456.00	0.33
55	002157	正邦科技	26,700	444,822.00	0.33
56	000413	东旭光电	86,000	442,040.00	0.32
57	002001	新和成	22,501	434,044.29	0.32
58	000860	顺鑫农业	8,980	418,917.00	0.31
59	002081	金螳螂	39,977	412,162.87	0.30
60	000977	浪潮信息	17,190	410,153.40	0.30
61	300146	汤臣倍健	21,100	409,340.00	0.30
62	002120	韵达股份	13,268	408,919.76	0.30

63	000768	中航飞机	25,860	407,295.00	0.30
64	300136	信维通信	16,595	405,747.75	0.30
65	002223	鱼跃医疗	16,224	399,434.88	0.29
66	300408	三环集团	20,350	395,807.50	0.29
67	002555	三七互娱	29,100	394,305.00	0.29
68	000596	古井贡酒	3,300	391,083.00	0.29
69	000686	东北证券	44,350	390,723.50	0.29
70	002271	东方雨虹	17,129	388,143.14	0.29
71	002508	老板电器	14,300	388,102.00	0.29
72	002371	北方华创	5,600	387,800.00	0.28
73	000425	徐工机械	86,900	387,574.00	0.28
74	000423	东阿阿胶	9,713	386,771.66	0.28
75	300122	智飞生物	8,800	379,280.00	0.28
76	002405	四维图新	23,200	373,520.00	0.27
77	000728	国元证券	40,300	369,551.00	0.27
78	002673	西部证券	36,348	366,387.84	0.27
79	002373	千方科技	21,300	364,230.00	0.27
80	002311	海大集团	11,640	359,676.00	0.26
81	000778	新兴铸管	80,800	358,752.00	0.26
82	002129	中环股份	36,400	355,264.00	0.26
83	002299	圣农发展	14,000	354,480.00	0.26
84	002352	顺丰控股	10,300	349,788.00	0.26
85	000066	中国长城	33,828	347,751.84	0.26
86	002624	完美世界	13,400	345,854.00	0.25
87	002191	劲嘉股份	27,700	343,757.00	0.25
88	000975	银泰资源	25,880	341,357.20	0.25
89	002127	南极电商	30,100	338,324.00	0.25
90	000547	航天发展	35,100	335,556.00	0.25

91	002241	歌尔股份	37,114	329,943.46	0.24
92	002038	双鹭药业	13,913	327,790.28	0.24
93	300760	迈瑞医疗	2,000	326,400.00	0.24
94	000401	冀东水泥	18,500	325,785.00	0.24
95	300383	光环新网	19,400	325,338.00	0.24
96	002110	三钢闽光	34,750	323,175.00	0.24
97	000961	中南建设	37,200	322,152.00	0.24
98	002916	深南电路	3,160	322,067.20	0.24
99	002146	荣盛发展	34,100	320,199.00	0.24
100	002439	启明星辰	11,900	320,110.00	0.24
101	002340	格林美	67,710	318,914.10	0.23
102	000703	恒逸石化	23,340	318,824.40	0.23
103	300144	宋城演艺	13,585	314,356.90	0.23
104	300274	阳光电源	33,460	312,851.00	0.23
105	000938	紫光股份	11,468	312,503.00	0.23
106	002456	欧菲光	39,835	312,306.40	0.23
107	000402	金融街	39,833	312,290.72	0.23
108	300253	卫宁健康	22,012	312,130.16	0.23
109	000970	中科三环	27,500	312,125.00	0.23
110	002465	海格通信	32,630	311,290.20	0.23
111	000786	北新建材	17,096	309,950.48	0.23
112	000983	西山煤电	50,606	306,672.36	0.23
113	002372	伟星新材	17,360	302,064.00	0.22
114	000630	铜陵有色	121,400	298,644.00	0.22
115	002155	湖南黄金	28,945	291,476.15	0.21
116	002085	万丰奥威	39,980	291,054.40	0.21
117	000598	兴蓉环境	63,900	290,745.00	0.21
118	000625	长安汽车	43,597	289,048.11	0.21

119	300450	先导智能	8,588	288,556.80	0.21
120	002152	广电运通	42,075	288,213.75	0.21
121	000540	中天金融	75,150	287,824.50	0.21
122	002273	水晶光电	24,815	287,357.70	0.21
123	002690	美亚光电	8,800	286,880.00	0.21
124	000738	航发控制	20,851	279,403.40	0.21
125	000656	金科股份	46,300	279,189.00	0.21
126	002368	太极股份	9,200	278,760.00	0.20
127	002384	东山精密	19,050	277,558.50	0.20
128	002065	东华软件	39,500	276,105.00	0.20
129	300418	昆仑万维	21,200	272,844.00	0.20
130	002385	大北农	51,450	272,170.50	0.20
131	002563	森马服饰	24,600	272,076.00	0.20
132	002493	荣盛石化	22,550	271,953.00	0.20
133	000997	新大陆	16,000	270,240.00	0.20
134	300070	碧水源	34,622	269,705.38	0.20
135	000623	吉林敖东	16,315	267,402.85	0.20
136	300296	利亚德	33,850	265,045.50	0.19
137	300012	华测检测	24,500	264,600.00	0.19
138	002500	山西证券	32,400	262,440.00	0.19
139	002739	万达电影	14,104	260,077.76	0.19
140	000709	河钢股份	86,900	259,831.00	0.19
141	002268	卫士通	10,620	259,659.00	0.19
142	002797	第一创业	40,720	258,164.80	0.19
143	000031	大悦城	39,687	254,790.54	0.19
144	002050	三花智控	23,925	252,408.75	0.19
145	000503	国新健康	14,700	252,252.00	0.19
146	002092	中泰化学	31,400	249,944.00	0.18

147	300010	立思辰	26,601	249,783.39	0.18
148	002252	上海莱士	35,900	249,505.00	0.18
149	002444	巨星科技	24,900	248,502.00	0.18
150	000060	中金岭南	52,641	246,886.29	0.18
151	002408	齐翔腾达	31,400	243,350.00	0.18
152	002032	苏泊尔	3,200	242,656.00	0.18
153	002013	中航机电	35,170	241,969.60	0.18
154	002506	协鑫集成	35,900	239,812.00	0.18
155	300168	万达信息	18,300	237,351.00	0.17
156	002128	露天煤业	27,300	236,145.00	0.17
157	002821	凯莱英	2,400	235,392.00	0.17
158	000717	韶钢松山	53,100	235,233.00	0.17
159	000988	华工科技	14,799	234,120.18	0.17
160	002051	中工国际	20,214	231,854.58	0.17
161	000830	鲁西化工	20,900	227,392.00	0.17
162	300271	华宇软件	11,882	225,758.00	0.17
163	000848	承德露露	26,860	223,743.80	0.16
164	000690	宝新能源	34,700	223,468.00	0.16
165	002353	杰瑞股份	9,651	222,938.10	0.16
166	002572	索菲亚	12,000	222,720.00	0.16
167	000999	华润三九	7,590	222,690.60	0.16
168	002048	宁波华翔	20,500	221,810.00	0.16
169	300014	亿纬锂能	7,175	218,550.50	0.16
170	002242	九阳股份	10,500	218,505.00	0.16
171	002925	盈趣科技	5,600	218,456.00	0.16
172	002153	石基信息	6,000	217,140.00	0.16
173	000839	中信国安	53,300	214,266.00	0.16
174	000960	锡业股份	19,100	213,347.00	0.16

175	000009	中国宝安	37,300	212,983.00	0.16
176	002709	天赐材料	8,800	212,960.00	0.16
177	000039	中集集团	19,920	212,745.60	0.16
178	000750	国海证券	42,000	211,260.00	0.16
179	000723	美锦能源	20,200	211,090.00	0.16
180	000050	深天马 A	15,700	211,008.00	0.16
181	000671	阳光城	32,150	208,332.00	0.15
182	300601	康泰生物	3,900	204,750.00	0.15
183	002217	合力泰	36,500	201,845.00	0.15
184	002281	光迅科技	7,600	201,248.00	0.15
185	300088	长信科技	39,400	199,364.00	0.15
186	300166	东方国信	16,199	199,085.71	0.15
187	000581	威孚高科	10,616	197,032.96	0.14
188	000513	丽珠集团	5,891	195,757.93	0.14
189	002078	太阳纸业	28,600	194,766.00	0.14
190	300170	汉得信息	14,200	192,978.00	0.14
191	002601	龙蟠佰利	13,000	192,790.00	0.14
192	300072	三聚环保	24,300	192,699.00	0.14
193	002074	国轩高科	14,500	190,095.00	0.14
194	300413	芒果超媒	4,600	188,830.00	0.14
195	300357	我武生物	5,540	187,916.80	0.14
196	300001	特锐德	10,400	187,408.00	0.14
197	002075	沙钢股份	23,800	186,592.00	0.14
198	300009	安科生物	11,598	184,408.20	0.14
199	002600	领益智造	30,900	183,237.00	0.13
200	300098	高新兴	22,723	181,329.54	0.13
201	002251	步步高	22,700	180,919.00	0.13
202	002019	亿帆医药	14,600	178,850.00	0.13

203	002138	顺络电子	10,100	177,558.00	0.13
204	000878	云南铜业	16,702	177,542.26	0.13
205	000627	天茂集团	27,200	176,528.00	0.13
206	300027	华谊兄弟	35,933	176,431.03	0.13
207	002185	华天科技	34,590	176,063.10	0.13
208	300285	国瓷材料	10,300	175,203.00	0.13
209	000898	鞍钢股份	46,020	174,415.80	0.13
210	300226	上海钢联	2,300	172,408.00	0.13
211	000932	华菱钢铁	36,080	172,101.60	0.13
212	002396	星网锐捷	7,598	170,499.12	0.13
213	300212	易华录	6,864	168,168.00	0.12
214	000729	燕京啤酒	25,300	167,992.00	0.12
215	000563	陕国投 A	37,500	166,500.00	0.12
216	002310	东方园林	27,700	166,200.00	0.12
217	000800	一汽轿车	16,700	164,328.00	0.12
218	002212	南洋股份	11,900	163,030.00	0.12
219	002440	闰土股份	13,050	162,603.00	0.12
220	002511	中顺洁柔	13,100	160,868.00	0.12
221	300180	华峰超纤	11,400	159,828.00	0.12
222	002294	信立泰	7,100	158,898.00	0.12
223	002174	游族网络	9,401	158,688.88	0.12
224	000089	深圳机场	17,579	156,277.31	0.11
225	000732	泰禾集团	9,436	155,694.00	0.11
226	002602	世纪华通	14,148	154,496.16	0.11
227	002233	塔牌集团	13,200	154,176.00	0.11
228	300058	蓝色光标	36,022	153,813.94	0.11
229	300182	捷成股份	34,845	153,666.45	0.11
230	000758	中色股份	27,838	152,830.62	0.11

231	300316	晶盛机电	12,020	152,533.80	0.11
232	000516	国际医学	29,950	152,146.00	0.11
233	300315	掌趣科技	43,950	151,627.50	0.11
234	002131	利欧股份	79,110	151,100.10	0.11
235	300188	美亚柏科	8,400	149,772.00	0.11
236	000807	云铝股份	31,900	149,611.00	0.11
237	002773	康弘药业	4,535	149,292.20	0.11
238	000877	天山股份	12,800	148,736.00	0.11
239	300676	华大基因	2,600	148,304.00	0.11
240	300203	聚光科技	6,200	148,180.00	0.11
241	000683	远兴能源	56,700	147,987.00	0.11
242	002583	海能达	17,540	147,160.60	0.11
243	002399	海普瑞	6,994	146,804.06	0.11
244	002266	浙富控股	30,800	146,300.00	0.11
245	002589	瑞康医药	19,110	145,044.90	0.11
246	002648	卫星石化	9,700	144,336.00	0.11
247	002237	恒邦股份	8,500	142,035.00	0.10
248	002023	海特高新	11,600	141,984.00	0.10
249	000488	晨鸣纸业	26,350	141,236.00	0.10
250	002183	怡亚通	29,500	140,715.00	0.10
251	000591	太阳能	42,900	140,712.00	0.10
252	002449	国星光电	10,580	140,502.40	0.10
253	000883	湖北能源	32,300	140,182.00	0.10
254	300113	顺网科技	8,930	140,022.40	0.10
255	000528	柳工	20,860	138,927.60	0.10
256	300207	欣旺达	11,902	137,111.04	0.10
257	300339	润和软件	9,700	136,770.00	0.10
258	300038	数知科技	14,600	136,656.00	0.10

259	000887	中鼎股份	14,200	136,178.00	0.10
260	000826	启迪环境	11,480	135,349.20	0.10
261	000027	深圳能源	21,730	134,726.00	0.10
262	002610	爱康科技	71,500	133,705.00	0.10
263	002407	多氟多	11,250	133,200.00	0.10
264	002640	跨境通	15,900	132,447.00	0.10
265	000681	视觉中国	6,800	131,784.00	0.10
266	000008	神州高铁	34,900	131,573.00	0.10
267	300251	光线传媒	19,340	131,512.00	0.10
268	000040	东旭蓝天	19,800	131,472.00	0.10
269	000650	仁和药业	18,100	130,501.00	0.10
270	000998	隆平高科	9,000	130,320.00	0.10
271	002595	豪迈科技	6,200	130,262.00	0.10
272	002180	纳思达	5,700	128,820.00	0.09
273	002042	华孚时尚	17,700	128,502.00	0.09
274	002665	首航节能	37,880	128,413.20	0.09
275	300244	迪安诊断	7,500	127,350.00	0.09
276	300073	当升科技	5,500	126,335.00	0.09
277	300567	精测电子	2,400	126,048.00	0.09
278	002004	华邦健康	25,850	125,631.00	0.09
279	300451	创业慧康	8,400	125,580.00	0.09
280	002727	一心堂	4,400	125,356.00	0.09
281	002176	江特电机	25,575	124,550.25	0.09
282	002402	和而泰	13,100	124,057.00	0.09
283	000046	泛海控股	22,100	123,318.00	0.09
284	300463	迈克生物	4,900	123,137.00	0.09
285	002491	通鼎互联	15,000	121,350.00	0.09
286	300115	长盈精密	11,549	121,149.01	0.09

287	002670	国盛金控	9,576	120,657.60	0.09
288	002926	华西证券	11,400	119,700.00	0.09
289	002701	奥瑞金	25,620	119,645.40	0.09
290	000793	华闻传媒	35,600	119,616.00	0.09
291	300133	华策影视	17,760	119,524.80	0.09
292	300496	中科创达	4,100	119,228.00	0.09
293	002025	航天电器	4,821	117,535.98	0.09
294	002468	申通快递	4,700	117,218.00	0.09
295	000902	新洋丰	10,900	116,957.00	0.09
296	002030	达安基因	10,891	116,860.43	0.09
297	002603	以岭药业	10,068	116,587.44	0.09
298	002558	巨人网络	6,400	116,288.00	0.09
299	000400	许继电气	12,800	115,968.00	0.09
300	300026	红日药业	33,500	115,575.00	0.08
301	000059	华锦股份	18,000	115,200.00	0.08
302	002249	大洋电机	26,300	114,142.00	0.08
303	000727	华东科技	54,600	114,114.00	0.08
304	002151	北斗星通	4,900	113,827.00	0.08
305	000021	深科技	14,000	113,820.00	0.08
306	002262	恩华药业	10,500	113,295.00	0.08
307	002244	滨江集团	27,000	112,050.00	0.08
308	002497	雅化集团	16,000	111,840.00	0.08
309	002488	金固股份	13,400	111,622.00	0.08
310	002056	横店东磁	14,600	110,960.00	0.08
311	000818	航锦科技	10,400	110,760.00	0.08
312	002426	胜利精密	43,100	110,336.00	0.08
313	000156	华数传媒	10,000	110,100.00	0.08
314	002618	丹邦科技	8,200	109,962.00	0.08

315	002010	传化智联	14,600	109,938.00	0.08
316	300433	蓝思科技	15,760	109,847.20	0.08
317	300002	神州泰岳	27,432	109,179.36	0.08
318	300054	鼎龙股份	13,700	108,915.00	0.08
319	002376	新北洋	9,100	108,745.00	0.08
320	300324	旋极信息	18,713	108,348.27	0.08
321	002831	裕同科技	5,650	108,310.50	0.08
322	000028	国药一致	2,587	108,214.21	0.08
323	000685	中山公用	12,500	106,750.00	0.08
324	000926	福星股份	15,400	106,568.00	0.08
325	300616	尚品宅配	1,400	105,868.00	0.08
326	300482	万孚生物	2,800	105,560.00	0.08
327	300068	南都电源	9,300	105,090.00	0.08
328	300145	中金环境	24,080	104,507.20	0.08
329	000078	海王生物	30,000	104,400.00	0.08
330	300377	赢时胜	9,200	104,144.00	0.08
331	300558	贝达药业	2,500	103,750.00	0.08
332	002302	西部建设	9,300	103,602.00	0.08
333	002168	惠程科技	11,700	103,545.00	0.08
334	002419	天虹股份	7,900	103,174.00	0.08
335	002573	清新环境	12,800	103,040.00	0.08
336	002643	万润股份	10,200	103,020.00	0.08
337	300078	思创医惠	10,080	102,916.80	0.08
338	000012	南玻A	24,733	102,889.28	0.08
339	300197	铁汉生态	28,588	102,630.92	0.08
340	000301	东方盛虹	18,600	102,114.00	0.08
341	300036	超图软件	6,900	101,982.00	0.07
342	000016	深康佳A	24,200	101,640.00	0.07

343	000006	深振业 A	18,600	101,370.00	0.07
344	000718	苏宁环球	29,090	100,651.40	0.07
345	002280	联络互动	27,350	100,101.00	0.07
346	300085	银之杰	7,010	99,471.90	0.07
347	002839	张家港行	17,600	99,088.00	0.07
348	000712	锦龙股份	7,700	98,868.00	0.07
349	002358	森源电气	9,700	98,455.00	0.07
350	300367	东方网力	9,950	98,206.50	0.07
351	002596	海南瑞泽	12,100	97,768.00	0.07
352	002672	东江环保	8,600	97,524.00	0.07
353	002285	世联行	21,400	96,514.00	0.07
354	000901	航天科技	7,750	96,410.00	0.07
355	002366	台海核电	10,300	96,408.00	0.07
356	300294	博雅生物	3,550	96,382.50	0.07
357	000158	常山北明	17,750	96,205.00	0.07
358	002118	紫鑫药业	14,200	95,708.00	0.07
359	300355	蒙草生态	23,340	95,694.00	0.07
360	002608	江苏国信	11,200	95,536.00	0.07
361	300053	欧比特	9,500	94,810.00	0.07
362	002028	思源电气	9,500	94,620.00	0.07
363	002597	金禾实业	5,100	93,024.00	0.07
364	300308	中际旭创	2,720	92,452.80	0.07
365	000789	万年青	9,210	92,284.20	0.07
366	300037	新宙邦	4,400	91,696.00	0.07
367	300159	新研股份	18,400	91,632.00	0.07
368	002716	金贵银业	11,690	91,182.00	0.07
369	002807	江阴银行	19,300	90,324.00	0.07
370	300348	长亮科技	6,150	89,175.00	0.07

371	300118	东方日升	8,700	88,566.00	0.07
372	002091	江苏国泰	15,500	88,505.00	0.07
373	002421	达实智能	23,400	87,282.00	0.06
374	002430	杭氧股份	7,200	86,832.00	0.06
375	000555	神州信息	7,600	86,488.00	0.06
376	002383	合众思壮	7,600	86,336.00	0.06
377	000990	诚志股份	5,200	85,332.00	0.06
378	002390	信邦制药	16,050	84,583.50	0.06
379	002544	杰赛科技	6,500	84,500.00	0.06
380	002745	木林森	7,200	84,384.00	0.06
381	002812	恩捷股份	1,800	84,150.00	0.06
382	000937	冀中能源	21,715	83,819.90	0.06
383	300458	全志科技	4,007	83,746.30	0.06
384	002614	奥佳华	5,100	83,232.00	0.06
385	000426	兴业矿业	15,300	82,161.00	0.06
386	000553	安道麦 A	7,600	81,472.00	0.06
387	000559	万向钱潮	13,600	81,328.00	0.06
388	002429	兆驰股份	29,650	81,241.00	0.06
389	300699	光威复材	2,480	81,096.00	0.06
390	002607	中公教育	5,900	81,007.00	0.06
391	002156	通富微电	9,500	80,560.00	0.06
392	000935	四川双马	5,000	79,950.00	0.06
393	002635	安洁科技	5,900	79,591.00	0.06
394	002341	新纶科技	13,600	79,424.00	0.06
395	300618	寒锐钴业	1,320	79,200.00	0.06
396	000564	供销大集	30,300	79,083.00	0.06
397	002292	奥飞娱乐	12,300	78,843.00	0.06
398	000825	太钢不锈	19,300	78,551.00	0.06

399	300199	翰宇药业	8,500	77,945.00	0.06
400	002108	沧州明珠	19,729	76,943.10	0.06
401	300222	科大智能	5,900	76,818.00	0.06
402	002815	崇达技术	4,900	76,391.00	0.06
403	002611	东方精工	19,600	75,460.00	0.06
404	000088	盐田港	13,800	75,348.00	0.06
405	000869	张裕A	2,300	73,876.00	0.05
406	000980	众泰汽车	17,500	73,675.00	0.05
407	000034	神州数码	5,700	73,530.00	0.05
408	300257	开山股份	6,600	73,128.00	0.05
409	002080	中材科技	8,060	73,023.60	0.05
410	000062	深圳华强	5,410	71,898.90	0.05
411	002737	葵花药业	4,500	69,255.00	0.05
412	002258	利尔化学	5,300	69,165.00	0.05
413	002681	奋达科技	16,021	67,929.04	0.05
414	002437	誉衡药业	16,791	66,324.45	0.05
415	000910	大亚圣象	5,900	65,726.00	0.05
416	300055	万邦达	9,000	64,170.00	0.05
417	002517	恺英网络	20,000	63,800.00	0.05
418	002434	万里扬	9,200	62,468.00	0.05
419	002382	蓝帆医疗	4,500	62,190.00	0.05
420	002503	搜于特	22,100	60,775.00	0.04
421	300373	扬杰科技	4,000	59,960.00	0.04
422	002509	天广中茂	28,800	59,328.00	0.04
423	000989	九芝堂	6,600	58,740.00	0.04
424	000525	红太阳	4,500	58,095.00	0.04
425	300409	道氏技术	4,500	56,835.00	0.04
426	000959	首钢股份	14,900	52,448.00	0.04

427	000766	通化金马	7,600	51,680.00	0.04
428	002320	海峡股份	5,750	51,405.00	0.04
429	300474	景嘉微	1,300	51,298.00	0.04
430	002625	光启技术	5,413	50,286.77	0.04
431	000987	越秀金控	5,500	49,610.00	0.04
432	300323	华灿光电	7,900	48,822.00	0.04
433	002920	德赛西威	2,100	47,040.00	0.03
434	002389	航天彩虹	4,100	45,756.00	0.03
435	000710	贝瑞基因	1,100	39,226.00	0.03
436	002016	世荣兆业	4,500	36,900.00	0.03
437	300476	胜宏科技	3,000	33,900.00	0.02
438	000537	广宇发展	4,700	32,524.00	0.02
439	002061	浙江交科	5,200	31,096.00	0.02
440	000930	中粮生化	4,100	30,832.00	0.02
441	002035	华帝股份	2,500	30,450.00	0.02
442	002505	大康农业	14,300	28,171.00	0.02
443	000415	渤海租赁	682	2,673.44	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300770	新媒股份	1,271	109,941.50	0.08
2	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.06
3	002668	奥马电器	10,218	52,929.24	0.04
4	000587	金洲慈航	17,100	44,118.00	0.03
5	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.02
6	002477	*ST 雏鹰	33,100	31,445.00	0.02
7	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.02

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	000333	美的集团	1,376,160.00	1.32
2	000858	五粮液	1,128,900.00	1.08
3	300498	温氏股份	1,003,990.00	0.96
4	002027	分众传媒	893,864.00	0.86
5	300059	东方财富	832,298.00	0.80
6	002415	海康威视	828,300.27	0.79
7	000651	格力电器	824,628.00	0.79
8	300750	宁德时代	704,535.00	0.68
9	002475	立讯精密	640,002.88	0.61
10	000002	万科A	614,907.00	0.59
11	000568	泸州老窖	532,775.00	0.51
12	000725	京东方A	502,584.00	0.48
13	000166	申万宏源	475,888.00	0.46
14	000001	平安银行	465,961.00	0.45
15	000661	长春高新	446,375.00	0.43
16	000425	徐工机械	441,719.00	0.42
17	000338	潍柴动力	433,535.00	0.42
18	002128	露天煤业	432,005.00	0.41
19	000401	冀东水泥	427,037.34	0.41
20	002157	正邦科技	393,557.00	0.38

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	000858	五 粮 液	1,573,271.82	1.51
2	000333	美的集团	1,285,263.00	1.23
3	000651	格力电器	1,113,243.00	1.07
4	002415	海康威视	855,955.00	0.82
5	300059	东方财富	791,714.00	0.76
6	002475	立讯精密	628,836.00	0.60
7	300498	温氏股份	612,377.00	0.59
8	000568	泸州老窖	597,180.00	0.57
9	002466	天齐锂业	538,710.60	0.52
10	002027	分众传媒	526,243.00	0.50
11	000001	平安银行	500,604.00	0.48
12	000002	万 科 A	483,148.00	0.46
13	000401	冀东水泥	479,660.00	0.46
14	000725	京东方 A	460,337.00	0.44
15	000425	徐工机械	455,339.00	0.44
16	000661	长春高新	435,054.00	0.42
17	002304	洋河股份	418,590.00	0.40
18	002230	科大讯飞	403,538.00	0.39
19	002157	正邦科技	395,532.00	0.38
20	002250	联化科技	378,616.82	0.36

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	50,541,937.38
卖出股票收入（成交）总额	49,990,516.95

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	4,501,800.00	3.31
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	8,899.92	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,510,699.92	3.31

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	019608	18 国债 26	30,000	3,000,600.00	2.20
2	019600	18 国债 18	15,000	1,501,200.00	1.10
3	128068	和而转债	89	8,899.92	0.01

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	5,277.12
2	应收证券清算款	2,017,999.30
3	应收股利	-
4	应收利息	80,879.87
5	应收申购款	84,606.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,188,763.26

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

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
融通深证成份指数 A/B	7,440	22,133.46	198,051.80	0.12%	164,474,912.95	99.88%
融通深证成份指数 C	1,570	3,602.80	0	0.00%	5,656,397.76	100.00%
合计	9,010	18,904.48	198,051.80	0.12%	170,131,310.71	99.88%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	融通深证成份指数 A/B	63,490.61	0.0386%
	融通深证成份指数 C	11,860.69	0.2097%
	合计	75,351.30	0.0442%

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通深证成份指数 A/B	融通深证成份指数 C
基金合同生效日（2010 年 11 月 15 日） 基金份额总额	1,848,841,553.44	-
本报告期期初基金份额总额	165,371,428.39	1,663,921.92
本报告期基金总申购份额	30,986,987.51	18,385,137.40
减：本报告期基金总赎回份额	31,685,451.15	14,392,661.56
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	164,672,964.75	5,656,397.76

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人无重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	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	
中信证券	1	72,117,853.48	72.71%	65,720.73	72.71%	-
长江证券	1	23,848,089.52	24.05%	21,732.67	24.05%	-
安信证券	1	3,213,070.57	3.24%	2,928.06	3.24%	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富	1	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中信证券(山东)	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	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) 资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

- (3) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

2、选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的程序包括以下四个步骤：

- (1) 券商服务评价；
- (2) 拟定租用对象。由研究部根据以上评价结果拟定备选的券商；
- (3) 上报批准。研究部将拟定租用对象上报分管副总经理批准；
- (4) 签约。在获得批准后，按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

3、交易单元变更情况

本报告期内，本基金新增中泰证券交易单元 1 个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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
中信证券	38,486.71	0.74%	-	-	-	-
长江证券	313,255.63	6.05%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-

海通证券	319,700.00	6.17%	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方 财富	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券 (山东)	4,507,100.00	87.03%	400,000.00	100.00%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	披露方式	披露日期
1	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加国信证券股份有限公司申购及定期定额投资业务费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2019年1月15日
2	关于融通旗下部分开放式基金新增腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构的公告	证券时报、管理人网站	2019年1月25日
3	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金 新增南京苏宁基金销售有限公司为销售机构及参加其费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2019年1月26日
4	融通关于旗下部分开放式基金新增上海凯石财富基金销售有限公司为销售机构及参加其费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2019年1月30日
5	融通关于旗下部分开放式基金新增江苏汇林保大基金销售有限公司为销售机构的公告	证券时报、管理人网站	2019年3月25日

6	融通关于旗下部分开放式基金新增上海基煜基金销售有限公司为销售机构及参加其费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2019年3月25日
7	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司申购及定期定额投资业务费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2019年3月30日
8	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2019年3月30日
9	融通基金管理有限公司关于新增东海证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2019年4月8日
10	关于融通旗下部分开放式基金新增上海天天基金销售有限公司为销售机构的公告	证券时报、管理人网站	2019年4月17日
11	融通关于旗下部分开放式基金在上海好买基金销售有限公司开通基金转换业务的公告	证券时报、管理人网站	2019年4月17日
12	融通关于旗下部分开放式基金参加北京植信基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2019年4月19日
13	融通关于旗下部分开放式基金参加上海长量基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2019年4月26日
14	融通关于旗下部分开放式基金参加方德保险代理有限公司申购费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2019年5月15日
15	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增阳光人寿保险股份有限公司为销售机构的公告	证券时报、管理人网站	2019年5月15日
16	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增民商基金销售(上海)有限公司为销售机构及参加其费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2019年5月17日

17	融通关于旗下部分开放式基金参加中国银行股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2019 年 6 月 28 日
----	--	------------	-----------------

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准融通深证成份指数证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通深证成份指数证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通深证成份指数证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通深证成份指数证券投资基金招募说明书》及其更新
- (五) 融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- (六) 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件，或登陆本基金管理人网站 www.rtfund.com 查询。

融通基金管理有限公司

2019 年 8 月 24 日