

融通深证成份指数证券投资基金 2020 年年度报告

2020 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：2021 年 3 月 30 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 2021 年 3 月 26 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)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	21
§ 8 投资组合报告	44
8.1 期末基金资产组合情况	44
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44

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	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	58
8.7 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	58
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	58
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	58
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	58
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
8.12 投资组合报告附注	58
§ 9 基金份额持有人信息	59
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
9.3 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	60
§ 10 开放式基金份额变动	60
§ 11 重大事件揭示	60
11.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
11.4 基金投资策略的改变	61
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
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	61
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
11.8 其他重大事件	63
§ 12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录	65
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§ 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	102,389,034.19 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	-
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	90,976,992.33 份	11,412,041.86 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	融通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	涂卫东
	联系电话	(0755) 26948666
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com
客户服务电话	400-883-8088、(0755) 26948088	95588
传真	(0755) 26935005	(010) 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大厦 13、14、15 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518053	100140

法定代表人	高峰	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
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、15 层

§ 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 期间数据和指标	2020 年		2019 年		2018 年		
	融通深证成份指数 A/B	融通深证成份指数 C	融通深证成份指数 A/B	融通深证成份指数 C	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	37,278,283.03	3,571,388.75	-14,911,937.48	-550,544.30	-17,837,385.97	-85,943.97	
本期利润	47,456,041.78	3,271,470.08	47,892,138.79	1,067,031.45	-45,777,587.49	-125,715.77	
加权平均基金份额本期利润	0.3975	0.3259	0.2938	0.2037	-0.2842	-0.2905	
本期加权平均净值利润率	37.07%	29.70%	36.45%	25.19%	-35.99%	-42.99%	
本期基金份额净值增长率	44.10%	43.52%	46.79%	46.35%	-31.58%	-32.20%	
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末		
	期末可供分配利润	29,142,147.62	-189,083.55	-12,597,052.61	-1,517,104.64	-62,139,345.46	-636,555.05
	期末可供分配基金份额利润	0.3203	-0.0166	-0.0837	-0.3449	-0.3758	-0.3826
	期末基金资产净值	120,119,139.95	14,787,691.37	137,835,899.20	3,969,880.08	103,232,082.93	1,027,366.87

期末基金份额净值	1.320	1.296	0.916	0.903	0.624	0.617
3.1.3 累计期末指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
基金份额累计净值增长率	33.67%	49.83%	-7.24%	4.39%	-36.81%	-28.67%

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

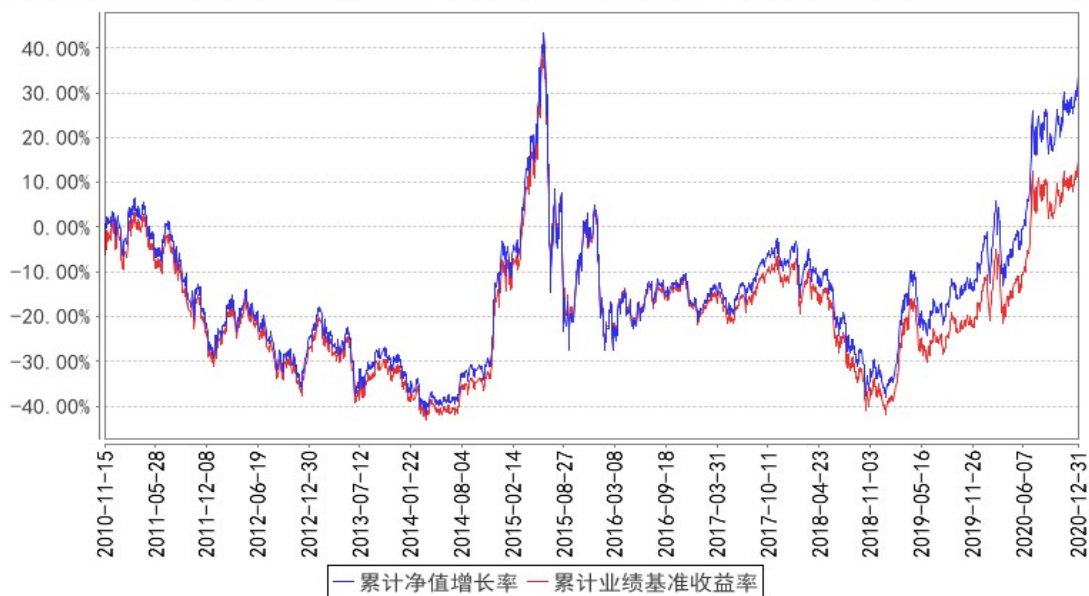
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	12.92%	1.15%	11.50%	1.13%	1.42%	0.02%
过去六个月	23.94%	1.46%	19.63%	1.44%	4.31%	0.02%
过去一年	44.10%	1.61%	36.73%	1.59%	7.37%	0.02%
过去三年	44.74%	1.49%	29.93%	1.48%	14.81%	0.01%
过去五年	31.96%	1.45%	14.36%	1.42%	17.60%	0.03%
自基金合同生效起至今	33.67%	1.57%	14.96%	1.53%	18.71%	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
过去三个月	12.79%	1.15%	11.50%	1.13%	1.29%	0.02%
过去六个月	23.78%	1.47%	19.63%	1.44%	4.15%	0.03%
过去一年	43.52%	1.62%	36.73%	1.59%	6.79%	0.03%
过去三年	42.42%	1.49%	29.93%	1.48%	12.49%	0.01%
自基金合同生效起 至今	49.83%	1.42%	35.57%	1.40%	14.26%	0.02%

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

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



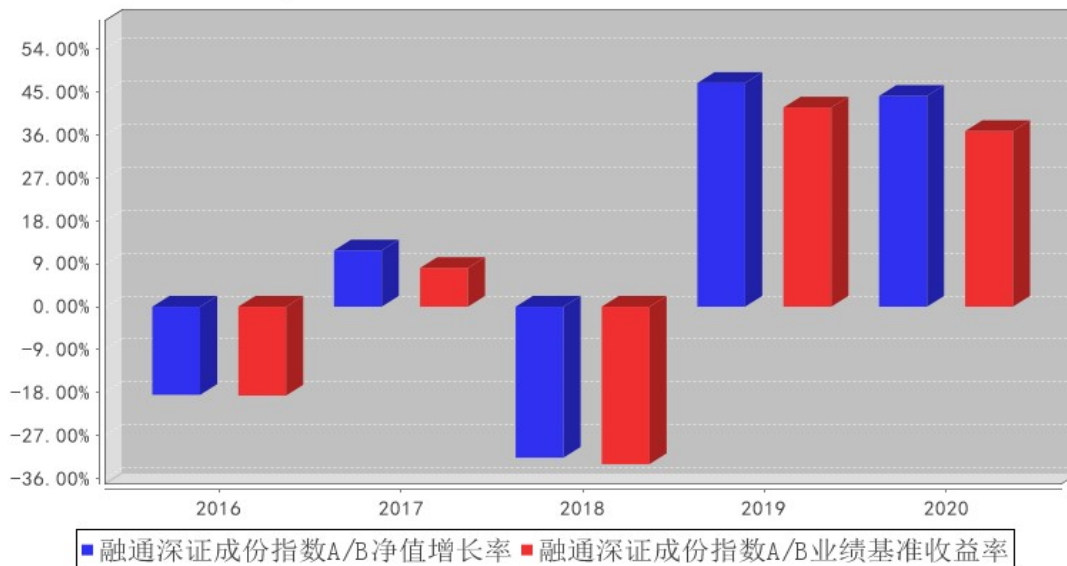
融通深证成份指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



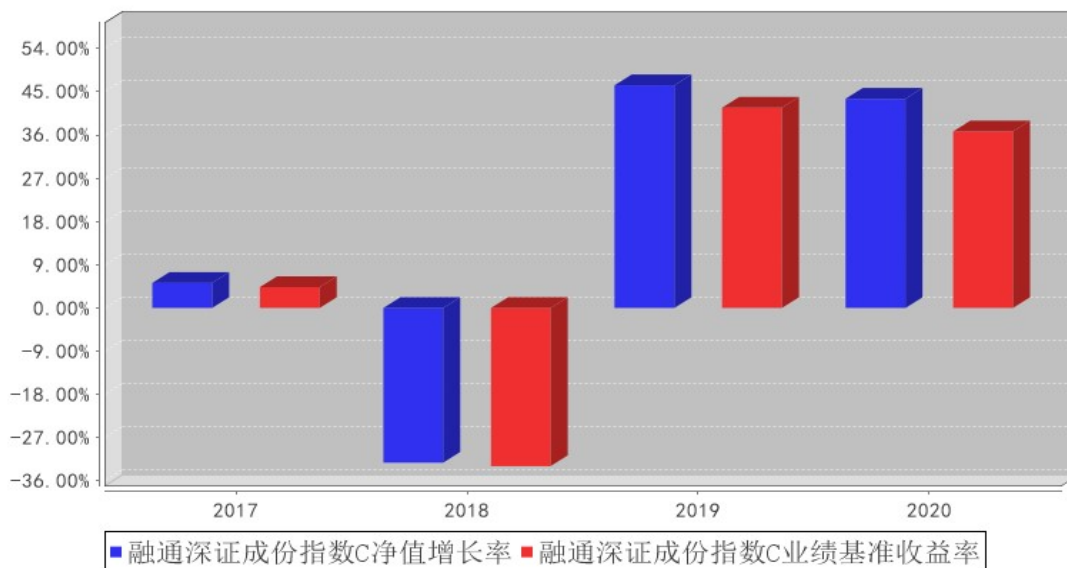
注:本基金于 2017 年 7 月 5 日增设 C 类份额, 本基金 C 类份额的统计区间为 2017 年 7 月 6 日至本报告期末。

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

融通深证成份指数A/B基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



融通深证成份指数C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

融通深证成份指数 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
2020	-	-	-	-	
2019	-	-	-	-	
2018	-	-	-	-	
合计	-	-	-	-	

单位：人民币元

融通深证成份指数 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
2020	-	-	-	-	
2019	-	-	-	-	
2018	-	-	-	-	
合计	-	-	-	-	

§ 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（NikkoAssetManagementCo.,Ltd.）40%。

截至2020年12月31日，公司共管理七十六只开放式基金：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)、融通通盈灵活配置混合型证券投资基金、融通通慧混

合型证券投资基金、融通增祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、融通增强收益债券型证券投资基金、融通消费升级混合型证券投资基金、融通量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、融通通昊三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、融通增润三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、融通增享纯债债券型证券投资基金、融通产业趋势股票型证券投资基金、融通中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、融通产业趋势先锋股票型证券投资基金、融通通益混合型证券投资基金、融通通远三个月定期开放债券型证券投资基金、融通创业板交易型开放式指数证券投资基金、融通通恒 63 个月定期开放债券型证券投资基金、融通产业趋势臻选股票型证券投资基金、融通中证精准医疗主题指数证券投资基金 (LOF)、融通稳健添盈灵活配置混合型证券投资基金、融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金 (LOF)。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	-	9	蔡志伟先生, 计算机应用技术硕士, 金融风险经理 (FRM), 9 年证券、基金行业从业经历, 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、融通量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通创业板交易型开放式指数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、基金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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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 1.320 元，本报告期基金份额净值增长率为 44.10%；截至本报告期末融通深证成份指数 C 基金份额净值为 1.296 元，本报告期基金份额净值增长率为 43.52%；同期业绩比较基准收益率为 36.73%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年，从海内外宏观经济来看，随着新冠疫苗接种提高，疫情扰动减弱，2021 年全球经济共振复苏是大趋势。从国内经济来看，国内经济内生增长动力增强，顺周期的消费、制造业投资将继续回升，接替地产和基建投资；同时预计我国出口将维持韧性，净出口仍将构成重要支撑。从政策的角度来看，由于海外货币政策仍处宽松阶段，在疫情影响完全消退前，预计央行

货币政策将保持中性，难以实质性收紧。从企业盈利角度看，受益于全球共振式复苏，企业基本面回升或将持续至下半年，全年有望实现双位数增长。从资金面的角度看，居民资金正趋势性入场，预计 2021 年仍将为公募基金发行大年。总体而言，在企业盈利向好叠加增量资金入场，货币保持中性的环境下，预计 A 股市场仍有较好的投资机会。

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、光伏等高端制造业，以及科技新周期下的核心领域：5G、半导体、信息创新等长期受益；而顺周期的制造业和消费板块在全球经济共振复苏下也将迎来较好的修复机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

基金管理人坚持一切从保护基金持有人利益出发，继续致力于内控制度与机制的完善，加强合规控制与风险防范，确保基金运作符合法律法规和基金合同的要求。公司监察稽核部门通过合规审核、实时监控及专项检查等方法，对基金运作和公司管理进行独立的监察稽核，及时发现风险隐患，提出整改建议，并督促跟踪业务部门进行整改。

在专项稽核方面，公司监察稽核部门针对不同业务环节的风险特点，制定年度检查计划，并结合对各风险点风险程度的实时判断和评估，按照不同的检查频率，对投资决策、研究支持、交易执行、基金销售、后台运营、信息披露及员工职业操守管理等方面的重点业务环节进行专项检查，检查有关业务执行的合规性和风险控制措施的有效性，检查项目覆盖了相关业务的主要风险点。本报告期内，加大了对投资管理人员管控措施、投资决策流程及决策依据、交易执行及后台运作风险等敏感、重点项目的关注，确保基金运作的稳健合规。本基金管理人全年未发生合规及风险事故。

4.7 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其适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经公司总经理办公会议审批后方可实施。基金在采用新投资策略或投资新品种时，应评价现有估值政策和程序的适用性。其中研究部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以

及估值政策和程序进行评价，金融工程小组负责估值方法的研究、价格的计算及复核，登记清算部进行具体的估值核算并与基金托管人核对，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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人于 2021 年 1 月 19 日实施 2020 年第 1 次利润分配，以 2020 年 12 月 31 日的可分配收益为基准，融通深证成份指数 A/B 每 10 份基金份额派发现金红利 0.33 元。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对融通深证成份指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

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深证成份指数证券投资基金 2020 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

普华永道中天审字(2021)第 22123 号

融通深证成份指数证券投资基金全体基金份额持有人：

一、 审计意见

(一) 我们审计的内容

我们审计了融通深证成份指数证券投资基金(以下简称“融通深证成份指数基金”)的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二) 我们的意见

我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了融通深证成份指数基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。

二、形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于融通深证成份指数基金,并履行了职业道德方面的其他责任。

三、管理层和治理层对财务报表的责任

融通深证成份指数基金的基金管理人融通基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估融通深证成份指数基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算融通深证成份指数基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督融通深证成份指数基金的财务报告过程。

四、注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们

也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对融通深证成份指数基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致融通深证成份指数基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天
会计师事务所(特殊普通合伙)
中国·上海市
2021 年 3 月 25 日

注册会计师 薛 竞
注册会计师 陈 邈 迺

§ 7 年度财务报表

7.1 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：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	7,398,788.44	3,091,364.52

结算备付金		121,378.90	145,441.74
存出保证金		11,303.13	5,367.86
交易性金融资产	7.4.7.2	126,963,272.59	139,640,262.05
其中：股票投资		126,963,272.59	134,547,073.01
基金投资		-	-
债券投资		-	5,093,189.04
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,796,775.85	196,749.01
应收利息	7.4.7.5	764.20	106,133.19
应收股利		-	-
应收申购款		48,350.78	194,469.24
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		137,340,633.89	143,379,787.61
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,011,822.04	1,143,006.90
应付管理人报酬		112,635.32	120,516.95
应付托管费		22,527.08	24,103.40
应付销售服务费		4,857.90	1,512.40
应付交易费用	7.4.7.7	120,613.55	122,349.86
应交税费		0.02	0.15
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	161,346.66	162,518.67
负债合计		2,433,802.57	1,574,008.33
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	102,389,034.19	154,831,267.38
未分配利润	7.4.7.10	32,517,797.13	-13,025,488.10
所有者权益合计		134,906,831.32	141,805,779.28
负债和所有者权益总计		137,340,633.89	143,379,787.61

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额总额 102,389,034.19 份，其中融通深证成份指数 A/B 基金份额总额为 90,976,992.33 份，基金份额净值 1.320 元；融通深证成份指数 C 基金份

额总额为 11,412,041.86 份，基金份额净值 1.296 元。

7.2 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		53,311,580.48	51,250,194.00
1. 利息收入		86,655.55	150,801.63
其中：存款利息收入	7.4.7.11	25,367.72	24,011.39
债券利息收入		61,287.83	126,790.24
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		43,197,023.35	-13,441,054.94
其中：股票投资收益	7.4.7.12	41,534,224.68	-15,299,736.88
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	150,155.49	38,588.02
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	1,512,643.18	1,820,093.92
3. 公允价值变动收益	7.4.7.17	9,877,840.08	64,421,652.02
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	7.4.7.18	150,061.50	118,795.29
减：二、费用		2,584,068.62	2,291,023.76
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,389,244.16	1,351,907.12
2. 托管费	7.4.10.2.2	277,848.91	270,381.32
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	43,555.11	16,796.76
4. 交易费用	7.4.7.19	713,114.21	491,638.87
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		0.23	0.07
7. 其他费用	7.4.7.20	160,306.00	160,276.00
三、利润总额		50,727,511.86	48,959,170.24
减：所得税费用		-	-
四、净利润		50,727,511.86	48,959,170.24

7.3 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	154,831,267.38	-13,025,488.10	141,805,779.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	50,727,511.86	50,727,511.86
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-52,442,233.19	-5,184,226.63	-57,626,459.82
其中：1. 基金申购款	81,780,700.07	5,732,083.37	87,512,783.44
2. 基金赎回款	-134,222,933.26	-10,916,310.00	-145,139,243.26
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	102,389,034.19	32,517,797.13	134,906,831.32
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	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）	-	48,959,170.24	48,959,170.24
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-12,204,082.93	791,242.17	-11,412,840.76
其中：1. 基金申购款	75,105,374.71	-14,545,827.49	60,559,547.22
2. 基金赎回款	-87,309,457.64	15,337,069.66	-71,972,387.98
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）	154,831,267.38	-13,025,488.10	141,805,779.28

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 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。本基金股票资产占基金资产的比例为90%-95%,其中投资于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%,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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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%。

7.4.2 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<年度报告和中期报告>》、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》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年度财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外, 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项, 包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时, 按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产, 取得时发生的相关交易费用计入当期损益;

对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份

额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若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，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本

基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	活期存款	7,398,788.44		3,091,364.52
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	7,398,788.44		3,091,364.52	

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日			公允价值变动
	成本	公允价值		
股票	98,644,419.07	126,963,272.59		28,318,853.52
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-		-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-		-
基金	-	-		-
其他	-	-		-
合计	98,644,419.07	126,963,272.59		28,318,853.52
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日			公允价值变动
	成本	公允价值		

股票		116,115,649.17	134,547,073.01	18,431,423.84
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	5,083,599.44	5,093,189.04	9,589.60
	银行间市场	-	-	-
	合计	5,083,599.44	5,093,189.04	9,589.60
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		121,199,248.61	139,640,262.05	18,441,013.44

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	704.50	553.79
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	54.60	65.40
应收债券利息	-	105,511.60
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	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	5.10	2.40
合计	764.20	106,133.19

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	120,613.55	122,349.86
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	120,613.55	122,349.86

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,346.66	2,518.67
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	160,000.00	160,000.00
合计	161,346.66	162,518.67

7.4.7.9 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	150,432,951.81	150,432,951.81
本期申购	44,121,535.82	44,121,535.82
本期赎回	-103,577,495.30	-103,577,495.30
本期末	90,976,992.33	90,976,992.33

融通深证成份指数 C

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,398,315.57	4,398,315.57
本期申购	37,659,164.25	37,659,164.25
本期赎回	-30,645,437.96	-30,645,437.96
本期末	11,412,041.86	11,412,041.86

注：A/B 类份额申购含转换入份额，赎回含转换出份额。C 类份额暂未开通转换业务。

7.4.7.10 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	20,501,294.03	-33,098,346.64	-12,597,052.61
本期利润	37,278,283.03	10,177,758.75	47,456,041.78
本期基金份额交易产生的变动数	-14,611,419.95	8,894,578.40	-5,716,841.55
其中：基金申购款	9,707,896.93	-6,862,129.63	2,845,767.30
基金赎回款	-24,319,316.88	15,756,708.03	-8,562,608.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	43,168,157.11	-14,026,009.49	29,142,147.62

融通深证成份指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

上年度末	-1,517,104.64	1,088,669.15	-428,435.49
本期利润	3,571,388.75	-299,918.67	3,271,470.08
本期基金份额交易产生的变动数	-2,243,367.66	2,775,982.58	532,614.92
其中：基金申购款	-9,354,237.07	12,240,553.14	2,886,316.07
基金赎回款	7,110,869.41	-9,464,570.56	-2,353,701.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-189,083.55	3,564,733.06	3,375,649.51

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	22,791.53	22,015.77
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	2,422.00	1,913.41
其他	154.19	82.21
合计	25,367.72	24,011.39

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出股票成交总额	258,514,533.03	168,786,798.82
减：卖出股票成本总额	216,980,308.35	184,086,535.70
买卖股票差价收入	41,534,224.68	-15,299,736.88

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	5,877,456.26	10,238,900.28
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	5,560,496.72	9,901,097.74
减：应收利息总额	166,804.05	299,214.52
买卖债券差价收入	150,155.49	38,588.02

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,512,643.18	1,820,093.92
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,512,643.18	1,820,093.92

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	9,877,840.08	64,421,652.02
股票投资	9,887,429.68	64,425,262.42
债券投资	-9,589.60	-3,610.40
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	9,877,840.08	64,421,652.02

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
基金赎回费收入	143,087.96	116,027.81
基金转换费收入	6,973.54	2,767.48
合计	150,061.50	118,795.29

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产；

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金赎回费用的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	713,114.21	491,638.87
银行间市场交易费用	-	-
合计	713,114.21	491,638.87

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	306.00	276.00
合计	160,306.00	160,276.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2021 年 1 月 13 日宣告 2020 年度第 1 次利润分配，向截至 2021 年 1 月 19 日止本基金注册登记人融通基金管理有限公司登记在册的全体 A/B 类份额持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.33 元。

7.4.9 关联方关系

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
新时代证券股份有限公司（“新时代证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
日兴资产管理有限公司	基金管理人的股东
融通国际资产管理有限公司	基金管理人的子公司
深圳市融通资本管理股份有限公司（“融通资本”）	本基金管理人能实施重大影响的联营企业

注：1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、融通资本为融通基金持有 52.575% 股权比例的基金管理公司子公司。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,389,244.16	1,351,907.12
其中：支付销售机构的客户维护费	592,697.98	563,918.15

注：1、支付基金管理人融通基金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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	277,848.91	270,381.32

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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

7.4.10.2.3 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 2020年1月1日至2020年12月31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	-	8,765.73	8,765.73
合计	-	8,765.73	8,765.73
获得销售服务费的各关联	上年度可比期间		

方名称	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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	-	233.26	233.26
合计	-	233.26	233.26

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		2019 年 1 月 1 日至 2019 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	7,398,788.44	22,791.53	3,091,364.52	22,015.77

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金的基金管理人于 2021 年 1 月 13 日宣告 2020 年度第 1 次利润分配，向截至 2021 年 1 月 19 日止本基金注册登记人融通基金管理有限公司登记在册的全体 A/B 类份额持有人，按每 10

份基金份额派发红利 0.33 元。

7.4.12 期末(2020 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
003030	祖名股份	2020/12/25	2021/1/6	首发流通受限	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020/12/24	2021/1/4	首发流通受限	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300860	锋尚文化	2020/8/6	2021/2/24	首发流通受限	138.02	126.67	64	8,833.28	8,106.88	-
300861	美畅股份	2020/8/6	2021/2/24	首发流通受限	43.76	51.10	179	7,833.04	9,146.90	-
300868	杰美特	2020/8/12	2021/2/24	首发流通受限	41.26	43.28	178	7,344.28	7,703.84	-
300869	康泰医学	2020/8/12	2021/2/24	首发流通受限	10.16	110.88	862	8,757.92	95,578.56	-
300872	天阳科技	2020/8/14	2021/2/25	首发流通受限	21.34	37.84	310	6,615.40	11,730.40	-
300873	海晨股份	2020/8/14	2021/3/2	首发流通受限	30.72	41.32	194	5,959.68	8,016.08	-
300876	蒙泰高新	2020/8/14	2021/2/25	首发流通受限	20.09	36.62	280	5,625.20	10,253.60	-
300877	金春股份	2020/8/17	2021/3/3	首发流通受限	30.54	50.85	251	7,665.54	12,763.35	-
300878	维康药业	2020/8/17	2021/3/3	首发流通受限	41.34	48.72	189	7,813.26	9,208.08	-
300879	大叶股份	2020/8/25	2021/3/1	首发流通受限	10.58	27.12	426	4,507.08	11,553.12	-
300880	迦南智能	2020/8/25	2021/3/1	首发流通受限	9.73	34.73	3,732	36,312.36	129,612.36	-
300881	盛德鑫泰	2020/8/25	2021/3/5	首发流通受限	14.17	32.31	291	4,123.47	9,402.21	-
300882	万胜智能	2020/8/27	2021/3/10	首发流通受限	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-
300884	狄耐克	2020/11/5	2021/5/12	首发流通受限	24.87	33.51	215	5,347.05	7,204.65	-
300886	华业香料	2020/9/8	2021/3/16	首发流通受限	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-

300887	谱尼测试	2020/9/9	2021/3/16	首发流通受限	44.47	74.52	117	5,202.99	8,718.84	-
300890	翔丰华	2020/9/10	2021/3/18	首发流通受限	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-
300891	惠云钛业	2020/9/10	2021/3/17	首发流通受限	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300893	松原股份	2020/9/17	2021/3/24	首发流通受限	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-
300894	火星人	2020/12/24	2021/7/1	首发流通受限	14.07	36.97	235	3,306.45	8,687.95	-
300896	爱美客	2020/9/21	2021/3/29	首发流通受限	118.27	603.36	52	6,150.04	31,374.72	-
300900	广联航空	2020/10/19	2021/4/29	首发流通受限	17.87	33.16	334	5,968.58	11,075.44	-
300908	仲景食品	2020/11/13	2021/5/24	首发流通受限	39.74	60.44	93	3,695.82	5,620.92	-
300910	瑞丰新材	2020/11/20	2021/5/27	首发流通受限	30.26	47.87	135	4,085.10	6,462.45	-
300911	亿田智能	2020/11/24	2021/6/3	首发流通受限	24.35	33.06	143	3,482.05	4,727.58	-
300913	兆龙互连	2020/11/27	2021/6/7	首发流通受限	13.21	23.94	486	6,420.06	11,634.84	-
300918	南山智尚	2020/12/15	2021/6/22	首发流通受限	4.97	8.94	677	3,364.69	6,052.38	-
300919	中伟股份	2020/12/15	2021/6/23	首发流通受限	24.60	61.51	159	3,911.40	9,780.09	-
300922	天秦装备	2020/12/18	2021/6/25	首发流通受限	16.05	31.58	198	3,177.90	6,252.84	-
300925	法本信息	2020/12/21	2021/6/30	首发流通受限	20.08	37.33	184	3,694.72	6,868.72	-
300926	博俊科技	2020/12/29	2021/7/7	首发流通受限	10.76	10.76	284	3,055.84	3,055.84	-
300926	博俊科技	2020/12/29	2021/1/7	首发流通受限	10.76	10.76	2,553	27,470.28	27,470.28	-
300927	江天化学	2020/12/29	2021/7/7	首发流通受限	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-
300927	江天化学	2020/12/29	2021/1/7	首发流通受限	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	-
300999	金龙鱼	2020/9/29	2021/4/15	首发流通受限	25.70	88.29	742	19,069.40	65,511.18	-

注：1、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股

票设置不低于 6 个月的限售期。

2、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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人中国工商银行，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 2020 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2019 年 12 月 31 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 3.59%)。

7.4.13.3 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 2020 年 12 月 31 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。

7.4.13.3.1 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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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 7.4.12。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%。于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值未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。于 2020 年 12 月 31 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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、存出保证金和债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,398,788.44	-	-	-	7,398,788.44
结算备付金	121,378.90	-	-	-	121,378.90
存出保证金	11,303.13	-	-	-	11,303.13
交易性金融资产	-	-	-	-126,963,272.59	126,963,272.59
应收利息	-	-	-	764.20	764.20

应收申购款	-	-	-	48,350.78	48,350.78
应收证券清算款	-	-	-	2,796,775.85	2,796,775.85
资产总计	7,531,470.47	-	-	129,809,163.42	137,340,633.89
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,011,822.04	2,011,822.04
应付管理人报酬	-	-	-	112,635.32	112,635.32
应付托管费	-	-	-	22,527.08	22,527.08
应付销售服务费	-	-	-	4,857.90	4,857.90
应付交易费用	-	-	-	120,613.55	120,613.55
应交税费	-	-	-	0.02	0.02
其他负债	-	-	-	161,346.66	161,346.66
负债总计	-	-	-	2,433,802.57	2,433,802.57
利率敏感度缺口	7,531,470.47	-	-	127,375,360.85	134,906,831.32
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,091,364.52	-	-	-	3,091,364.52
结算备付金	145,441.74	-	-	-	145,441.74
存出保证金	5,367.86	-	-	-	5,367.86
交易性金融资产	5,018,000.00	-	75,189.04	134,547,073.01	139,640,262.05
应收利息	-	-	-	106,133.19	106,133.19
应收申购款	-	-	-	194,469.24	194,469.24
应收证券清算款	-	-	-	196,749.01	196,749.01
资产总计	8,260,174.12	-	75,189.04	135,044,424.45	143,379,787.61
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,143,006.90	1,143,006.90
应付管理人报酬	-	-	-	120,516.95	120,516.95
应付托管费	-	-	-	24,103.40	24,103.40
应付销售服务费	-	-	-	1,512.40	1,512.40
应付交易费用	-	-	-	122,349.86	122,349.86
应交税费	-	-	-	0.15	0.15
其他负债	-	-	-	162,518.67	162,518.67
负债总计	-	-	-	1,574,008.33	1,574,008.33
利率敏感度缺口	8,260,174.12	-	75,189.04	133,470,416.12	141,805,779.28

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2019 年 12 月 31 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 3.59%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 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	126,963,272.59	94.11	134,547,073.01	94.88
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	126,963,272.59	94.11	134,547,073.01	94.88
----	----------------	-------	----------------	-------

7.4.13.4.3.2 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（2020年12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
	深证成份指数收益率上升5%	6,512,359.72	6,726,333.21
	深证成份指数收益率下降5%	-6,512,359.72	-6,726,333.21

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2020年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为126,317,080.56元，属于第二层次的余额为646,192.03元，无属于第三层次的余额(2019年12月31日：第一层次134,434,877.10元，第二层次5,205,384.95元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于本期末，本基金未持有属于第三层次的金融工具(2019年12月31日：同)

于 2020 年度，无第三层次变动。于 2019 年度，本基金转出第三层次的金额为 4,400.00 元，无计入损益的相关利得或损益。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	126,963,272.59	92.44
	其中：股票	126,963,272.59	92.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	7,520,167.34	5.48
8	其他各项资产	2,857,193.96	2.08
9	合计	137,340,633.89	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	2,785,008.74	2.06
B	采矿业	731,150.87	0.54
C	制造业	89,414,715.60	66.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	146,000.00	0.11
E	建筑业	243,506.03	0.18
F	批发和零售业	1,116,930.56	0.83
G	交通运输、仓储和邮政业	1,908,302.50	1.41
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,143,239.53	6.04
J	金融业	9,923,574.44	7.36
K	房地产业	3,870,881.23	2.87
L	租赁和商务服务业	1,713,103.68	1.27
M	科学研究和技术服务业	925,442.00	0.69
N	水利、环境和公共设施管理业	303,757.10	0.23
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	446,151.00	0.33
Q	卫生和社会工作	2,650,106.82	1.96
R	文化、体育和娱乐业	1,277,215.76	0.95
S	综合	166,864.80	0.12
	合计	125,765,950.66	93.22

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

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	784.00	0.00
C	制造业	974,690.87	0.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,492.00	0.00
E	建筑业	4,235.00	0.00
F	批发和零售业	67,186.00	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	8,016.08	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	116,716.36	0.09
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,364.00	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	8,718.84	0.01
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	12,118.78	0.01
S	综合	-	-
	合计	1,197,321.93	0.89

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000858	五粮液	19,246	5,616,945.10	4.16
2	000333	美的集团	48,003	4,725,415.32	3.50
3	000651	格力电器	54,602	3,382,047.88	2.51

4	300750	宁德时代	9,200	3,230,212.00	2.39
5	002475	立讯精密	49,757	2,792,362.84	2.07
6	300059	东方财富	76,546	2,372,926.00	1.76
7	000002	万科A	74,000	2,123,800.00	1.57
8	000725	京东方A	326,798	1,960,788.00	1.45
9	000001	平安银行	99,209	1,918,702.06	1.42
10	002415	海康威视	37,935	1,840,226.85	1.36
11	000568	泸州老窖	7,943	1,796,388.88	1.33
12	300760	迈瑞医疗	4,200	1,789,200.00	1.33
13	002594	比亚迪	8,244	1,601,809.20	1.19
14	002714	牧原股份	18,968	1,462,432.80	1.08
15	002352	顺丰控股	15,700	1,385,211.00	1.03
16	300015	爱尔眼科	18,476	1,383,667.64	1.03
17	002142	宁波银行	38,094	1,346,241.96	1.00
18	300124	汇川技术	14,298	1,334,003.40	0.99
19	002304	洋河股份	5,635	1,329,803.65	0.99
20	002027	分众传媒	125,964	1,243,264.68	0.92
21	000661	长春高新	2,694	1,209,363.54	0.90
22	002241	歌尔股份	28,314	1,056,678.48	0.78
23	300122	智飞生物	7,000	1,035,370.00	0.77
24	300498	温氏股份	53,778	980,372.94	0.73
25	000063	中兴通讯	28,577	961,616.05	0.71
26	000338	潍柴动力	60,840	960,663.60	0.71
27	000100	TCL 科技	128,120	907,089.60	0.67
28	300014	亿纬锂能	10,719	873,598.50	0.65
29	300274	阳光电源	10,860	784,960.80	0.58
30	300347	泰格医药	4,750	767,647.50	0.57
31	002410	广联达	9,600	755,904.00	0.56
32	002230	科大讯飞	18,363	750,495.81	0.56
33	300413	芒果超媒	10,040	727,900.00	0.54
34	000538	云南白药	6,242	709,091.20	0.53
35	002460	赣锋锂业	6,650	672,980.00	0.50
36	000157	中联重科	66,041	653,805.90	0.48
37	000895	双汇发展	13,617	639,181.98	0.47
38	002271	东方雨虹	16,343	634,108.40	0.47
39	002179	中航光电	7,942	621,779.18	0.46
40	002555	三七互娱	18,500	577,755.00	0.43
41	000625	长安汽车	26,397	577,566.36	0.43
42	002624	完美世界	19,400	572,300.00	0.42
43	300782	卓胜微	1,000	570,540.00	0.42
44	300450	先导智能	6,788	570,124.12	0.42
45	000876	新希望	25,000	560,000.00	0.42

46	300677	英科医疗	3,300	554,895.00	0.41
47	002812	恩捷股份	3,900	552,942.00	0.41
48	000776	广发证券	32,160	523,564.80	0.39
49	000166	申万宏源	99,020	522,825.60	0.39
50	002049	紫光国微	3,900	521,859.00	0.39
51	002311	海大集团	7,940	520,070.00	0.39
52	300601	康泰生物	2,900	506,050.00	0.38
53	002493	荣盛石化	18,250	503,882.50	0.37
54	002709	天赐材料	4,786	496,786.80	0.37
55	300142	沃森生物	12,800	493,568.00	0.37
56	300433	蓝思科技	16,060	491,596.60	0.36
57	000768	中航西飞	12,660	464,368.80	0.34
58	300496	中科创达	3,900	456,300.00	0.34
59	002007	华兰生物	10,785	455,558.40	0.34
60	001979	招商蛇口	34,263	455,355.27	0.34
61	002050	三花智控	18,183	448,210.95	0.33
62	002607	中公教育	12,700	446,151.00	0.33
63	300676	华大基因	3,400	437,104.00	0.32
64	002129	中环股份	17,100	436,050.00	0.32
65	000596	古井贡酒	1,600	435,200.00	0.32
66	300999	金龙鱼	4,142	433,799.18	0.32
67	002001	新和成	12,701	427,769.68	0.32
68	300408	三环集团	11,450	426,512.50	0.32
69	300454	深信服	1,700	421,617.00	0.31
70	002821	凯莱英	1,400	418,796.00	0.31
71	002074	国轩高科	10,700	418,584.00	0.31
72	300012	华测检测	15,200	416,024.00	0.31
73	002371	北方华创	2,300	415,702.00	0.31
74	000786	北新建材	9,996	400,339.80	0.30
75	300033	同花顺	3,200	396,736.00	0.29
76	002030	达安基因	11,400	391,020.00	0.29
77	002601	龙蟠佰利	12,600	387,702.00	0.29
78	002841	视源股份	3,300	379,599.00	0.28
79	300724	捷佳伟创	2,600	378,560.00	0.28
80	002008	大族激光	8,800	376,200.00	0.28
81	300037	新宙邦	3,700	375,180.00	0.28
82	300661	圣邦股份	1,400	369,320.00	0.27
83	300463	迈克生物	7,900	368,140.00	0.27
84	002236	大华股份	18,464	367,248.96	0.27
85	300003	乐普医疗	13,200	358,776.00	0.27
86	300285	国瓷材料	7,800	351,858.00	0.26
87	002557	洽洽食品	6,441	346,847.85	0.26

88	300073	当升科技	5,300	343,705.00	0.25
89	000860	顺鑫农业	4,700	340,938.00	0.25
90	300136	信维通信	9,495	340,680.60	0.25
91	000783	长江证券	40,025	336,210.00	0.25
92	000547	航天发展	12,200	335,500.00	0.25
93	002202	金风科技	23,488	334,704.00	0.25
94	000902	新洋丰	20,900	334,400.00	0.25
95	002736	国信证券	24,500	334,180.00	0.25
96	002414	高德红外	7,970	332,747.50	0.25
97	002044	美年健康	28,896	327,391.68	0.24
98	002384	东山精密	12,550	326,300.00	0.24
99	300253	卫宁健康	18,485	323,487.50	0.24
100	300502	新易盛	5,800	321,784.00	0.24
101	002185	华天科技	23,534	320,533.08	0.24
102	300207	欣旺达	10,402	319,445.42	0.24
103	000066	中国长城	16,728	317,664.72	0.24
104	000938	紫光股份	15,275	312,373.75	0.23
105	002024	苏宁易购	40,100	309,171.00	0.23
106	002797	第一创业	30,720	305,664.00	0.23
107	002705	新宝股份	7,200	304,200.00	0.23
108	000975	银泰黄金	35,072	301,969.92	0.22
109	002938	鹏鼎控股	6,000	298,020.00	0.22
110	002456	欧菲光	22,400	295,232.00	0.22
111	002626	金达威	8,400	291,228.00	0.22
112	000977	浪潮信息	10,764	289,336.32	0.21
113	002216	三全食品	11,100	288,045.00	0.21
114	000069	华侨城A	40,344	286,038.96	0.21
115	002340	格林美	40,910	285,960.90	0.21
116	300529	健帆生物	4,210	285,522.20	0.21
117	300144	宋城演艺	15,993	283,395.96	0.21
118	002382	蓝帆医疗	13,400	282,606.00	0.21
119	002127	南极电商	19,900	272,232.00	0.20
120	002013	中航机电	23,670	271,021.50	0.20
121	002155	湖南黄金	31,845	271,000.95	0.20
122	002600	领益智造	22,400	268,576.00	0.20
123	002405	四维图新	18,500	263,995.00	0.20
124	000728	国元证券	29,190	261,542.40	0.19
125	300308	中际旭创	5,120	260,403.20	0.19
126	300638	广和通	4,300	257,355.00	0.19
127	002157	正邦科技	15,100	257,304.00	0.19
128	000703	恒逸石化	19,822	253,721.60	0.19
129	000921	海信家电	17,400	250,734.00	0.19

130	002385	大北农	25,950	250,677.00	0.19
131	002568	百润股份	2,400	250,296.00	0.19
132	002463	沪电股份	13,300	249,907.00	0.19
133	300699	光威复材	2,788	248,271.40	0.18
134	002602	世纪华通	34,838	247,698.18	0.18
135	000425	徐工机械	45,900	246,483.00	0.18
136	002078	太阳纸业	16,600	239,538.00	0.18
137	300188	美亚柏科	11,000	236,940.00	0.18
138	000750	国海证券	40,230	235,747.80	0.17
139	000951	中国重汽	7,300	229,658.00	0.17
140	300595	欧普康视	2,800	229,376.00	0.17
141	002223	鱼跃医疗	7,924	223,536.04	0.17
142	300628	亿联网络	3,050	223,016.00	0.17
143	002465	海格通信	20,130	218,007.90	0.16
144	000963	华东医药	8,191	217,552.96	0.16
145	300558	贝达药业	2,000	214,740.00	0.16
146	000988	华工科技	9,099	211,005.81	0.16
147	002212	天融信	10,000	210,100.00	0.16
148	000656	金科股份	29,600	209,864.00	0.16
149	300383	光环新网	12,200	209,474.00	0.16
150	002120	韵达股份	13,085	205,434.50	0.15
151	000423	东阿阿胶	5,300	205,163.00	0.15
152	002500	山西证券	22,850	204,507.50	0.15
153	002439	启明星辰	7,000	204,470.00	0.15
154	002673	西部证券	20,148	204,300.72	0.15
155	002727	一心堂	6,100	203,191.00	0.15
156	300088	长信科技	22,300	198,247.00	0.15
157	002131	利欧股份	65,410	198,192.30	0.15
158	002422	科伦药业	10,116	196,655.04	0.15
159	000630	铜陵有色	76,500	196,605.00	0.15
160	002353	杰瑞股份	5,351	187,285.00	0.14
161	002926	华西证券	14,900	185,952.00	0.14
162	002080	中材科技	7,660	185,218.80	0.14
163	300357	我武生物	2,401	184,156.70	0.14
164	002250	联化科技	7,600	182,324.00	0.14
165	002065	东华软件	21,900	181,770.00	0.13
166	002156	通富微电	7,200	181,728.00	0.13
167	300271	华宇软件	7,573	180,767.51	0.13
168	002180	纳思达	6,700	179,091.00	0.13
169	300316	晶盛机电	5,920	178,073.60	0.13
170	002773	康弘药业	3,635	175,025.25	0.13
171	000021	深科技	9,100	172,991.00	0.13

172	000998	隆平高科	8,700	172,347.00	0.13
173	002916	深南电路	1,593	172,139.58	0.13
174	300244	迪安诊断	5,000	171,400.00	0.13
175	000961	中南建设	19,400	171,302.00	0.13
176	002299	圣农发展	6,400	169,856.00	0.13
177	002389	航天彩虹	5,100	169,575.00	0.13
178	000513	丽珠集团	4,158	168,399.00	0.12
179	002373	千方科技	8,800	168,256.00	0.12
180	002151	北斗星通	3,300	168,003.00	0.12
181	000878	云南铜业	11,602	167,880.94	0.12
182	300474	景嘉微	2,400	167,784.00	0.12
183	000009	中国宝安	22,160	166,864.80	0.12
184	300623	捷捷微电	3,800	165,300.00	0.12
185	000039	中集集团	11,000	164,890.00	0.12
186	002025	航天电器	2,521	164,318.78	0.12
187	300618	寒锐钴业	1,708	162,106.28	0.12
188	002019	亿帆医药	8,500	160,905.00	0.12
189	300070	碧水源	21,022	160,818.30	0.12
190	000686	东北证券	16,350	160,557.00	0.12
191	300115	长盈精密	6,449	158,967.85	0.12
192	002252	上海莱士	21,400	158,360.00	0.12
193	002683	宏大爆破	4,400	158,180.00	0.12
194	002572	索菲亚	6,100	157,990.00	0.12
195	002603	以岭药业	6,168	157,284.00	0.12
196	002511	中顺洁柔	7,500	156,525.00	0.12
197	002508	老板电器	3,800	154,964.00	0.11
198	300418	昆仑万维	7,700	153,615.00	0.11
199	300001	特锐德	5,200	152,672.00	0.11
200	002402	和而泰	8,800	151,976.00	0.11
201	300482	万孚生物	1,700	151,657.00	0.11
202	000739	普洛药业	6,500	151,320.00	0.11
203	300017	网宿科技	21,843	150,498.27	0.11
204	300315	掌趣科技	29,450	150,489.50	0.11
205	000050	深天马A	10,200	150,348.00	0.11
206	002081	金螳螂	15,977	150,024.03	0.11
207	000830	鲁西化工	11,700	149,526.00	0.11
208	002152	广电运通	13,675	146,049.00	0.11
209	002124	天邦股份	10,000	146,000.00	0.11
210	000690	宝新能源	20,000	146,000.00	0.11
211	300118	东方日升	5,000	144,150.00	0.11
212	300009	安科生物	9,747	143,085.96	0.11
213	300146	汤臣倍健	5,900	142,485.00	0.11

214	002648	卫星石化	5,400	141,048.00	0.10
215	000708	中信特钢	6,470	140,981.30	0.10
216	300212	易华录	4,597	140,898.05	0.10
217	002032	苏泊尔	1,800	140,382.00	0.10
218	002558	巨人网络	8,000	139,440.00	0.10
219	002595	豪迈科技	4,700	139,355.00	0.10
220	300251	光线传媒	11,540	139,287.80	0.10
221	300058	蓝色光标	23,122	138,732.00	0.10
222	000807	云铝股份	18,400	138,552.00	0.10
223	002056	横店东磁	9,100	138,229.00	0.10
224	002409	雅克科技	2,300	138,207.00	0.10
225	002939	长城证券	10,700	137,709.00	0.10
226	300296	利亚德	21,650	137,694.00	0.10
227	002444	巨星科技	4,400	136,884.00	0.10
228	002281	光迅科技	4,700	136,488.00	0.10
229	000738	航发控制	5,951	136,456.43	0.10
230	002138	顺络电子	5,500	134,860.00	0.10
231	002273	水晶光电	11,519	133,505.21	0.10
232	300346	南大光电	3,300	133,023.00	0.10
233	000581	威孚高科	5,716	132,554.04	0.10
234	000060	中金岭南	27,441	132,265.62	0.10
235	002146	荣盛发展	20,200	131,906.00	0.10
236	300747	锐科激光	1,500	131,790.00	0.10
237	002440	闰土股份	14,050	130,946.00	0.10
238	002429	兆驰股份	21,000	130,200.00	0.10
239	300379	东方通	2,800	127,960.00	0.09
240	300630	普利制药	3,035	127,136.15	0.09
241	000671	阳光城	19,350	126,162.00	0.09
242	000960	锡业股份	11,200	125,440.00	0.09
243	000997	新大陆	8,200	125,296.00	0.09
244	002643	万润股份	5,700	124,089.00	0.09
245	002436	兴森科技	13,100	123,926.00	0.09
246	002075	沙钢股份	11,200	122,864.00	0.09
247	300298	三诺生物	3,400	121,720.00	0.09
248	300068	南都电源	7,900	120,317.00	0.09
249	002690	美亚光电	2,700	119,556.00	0.09
250	002430	杭氧股份	4,100	119,269.00	0.09
251	300326	凯利泰	7,500	118,875.00	0.09
252	002028	思源电气	5,900	118,354.00	0.09
253	002920	德赛西威	1,400	117,796.00	0.09
254	002745	木林森	8,000	116,720.00	0.09
255	300054	鼎龙股份	6,100	115,351.00	0.09

256	300457	赢合科技	3,800	114,190.00	0.08
257	002807	江阴银行	26,600	113,848.00	0.08
258	002396	星网锐捷	4,898	112,947.88	0.08
259	000999	华润三九	4,500	112,230.00	0.08
260	300476	胜宏科技	5,200	112,164.00	0.08
261	002233	塔牌集团	8,800	112,112.00	0.08
262	002675	东诚药业	5,600	111,496.00	0.08
263	001914	招商积余	5,100	109,803.00	0.08
264	300223	北京君正	1,200	109,788.00	0.08
265	002541	鸿路钢构	3,000	109,590.00	0.08
266	300685	艾德生物	1,400	109,550.00	0.08
267	300451	创业慧康	8,050	108,916.50	0.08
268	002153	石基信息	3,500	108,815.00	0.08
269	002597	金禾实业	3,300	107,019.00	0.08
270	000933	神火股份	13,400	106,932.00	0.08
271	000403	双林生物	2,800	106,400.00	0.08
272	002064	华峰化学	10,500	105,945.00	0.08
273	002092	中泰化学	17,200	105,780.00	0.08
274	002268	卫士通	6,320	105,544.00	0.08
275	002023	海特高新	6,400	104,576.00	0.08
276	002368	太极股份	4,000	104,440.00	0.08
277	300567	精测电子	1,900	104,386.00	0.08
278	002387	维信诺	9,100	103,740.00	0.08
279	300226	上海钢联	1,580	103,648.00	0.08
280	000012	南玻A	13,900	102,582.00	0.08
281	300373	扬杰科技	2,300	102,166.00	0.08
282	002481	双塔食品	7,300	101,835.00	0.08
283	000729	燕京啤酒	11,900	101,388.00	0.08
284	000877	天山股份	6,700	101,170.00	0.07
285	002123	梦网科技	7,100	101,033.00	0.07
286	000800	一汽解放	8,600	100,448.00	0.07
287	002831	裕同科技	3,250	99,515.00	0.07
288	002294	信立泰	3,500	99,155.00	0.07
289	300236	上海新阳	2,000	98,580.00	0.07
290	002390	信邦制药	11,600	98,368.00	0.07
291	002372	伟星新材	5,200	97,240.00	0.07
292	002249	大洋电机	21,500	96,750.00	0.07
293	002839	张家港行	15,700	95,770.00	0.07
294	000400	许继电气	6,600	95,436.00	0.07
295	002191	劲嘉股份	10,300	95,069.00	0.07
296	000034	神州数码	4,400	94,424.00	0.07
297	000887	中鼎股份	8,000	93,680.00	0.07

298	300369	绿盟科技	6,100	93,208.00	0.07
299	002174	游族网络	7,001	92,133.16	0.07
300	000987	越秀金控	6,300	91,728.00	0.07
301	002262	恩华药业	5,700	91,029.00	0.07
302	000932	华菱钢铁	18,980	90,724.40	0.07
303	000401	冀东水泥	6,400	90,560.00	0.07
304	002701	奥瑞金	18,320	90,500.80	0.07
305	000488	晨鸣纸业	14,050	90,201.00	0.07
306	300166	东方国信	8,199	89,779.05	0.07
307	000970	中科三环	9,400	88,830.00	0.07
308	000089	深圳机场	10,800	88,236.00	0.07
309	002936	郑州银行	19,710	87,906.60	0.07
310	000712	锦龙股份	5,500	86,955.00	0.06
311	000930	中粮科技	10,300	86,726.00	0.06
312	300036	超图软件	4,700	86,668.00	0.06
313	300026	红日药业	18,900	86,562.00	0.06
314	300456	赛微电子	3,600	85,752.00	0.06
315	002237	恒邦股份	6,600	85,734.00	0.06
316	300072	三聚环保	14,400	81,792.00	0.06
317	002563	森马服饰	8,100	81,162.00	0.06
318	002531	天顺风能	9,600	80,832.00	0.06
319	000555	神州信息	5,200	80,600.00	0.06
320	002100	天康生物	7,600	80,484.00	0.06
321	000559	万向钱潮	15,000	80,250.00	0.06
322	002242	九阳股份	2,500	80,100.00	0.06
323	300376	易事特	9,800	78,008.00	0.06
324	002266	浙富控股	17,200	77,400.00	0.06
325	002867	周大生	2,900	77,285.00	0.06
326	300113	顺网科技	4,430	75,974.50	0.06
327	000528	柳工	10,160	74,777.60	0.06
328	002048	宁波华翔	4,800	74,736.00	0.06
329	000402	金融街	11,300	72,885.00	0.05
330	000710	贝瑞基因	1,900	72,314.00	0.05
331	000672	上峰水泥	3,700	72,187.00	0.05
332	002244	滨江集团	15,700	72,063.00	0.05
333	300458	全志科技	2,207	71,175.75	0.05
334	300180	华峰超纤	11,611	68,621.01	0.05
335	000158	常山北明	11,000	68,200.00	0.05
336	000028	国药一致	1,487	68,104.60	0.05
337	300078	思创医惠	7,380	66,789.00	0.05
338	000990	诚志股份	5,600	66,416.00	0.05
339	300741	华宝股份	1,200	65,844.00	0.05

340	002583	海能达	10,640	65,329.60	0.05
341	000681	视觉中国	5,000	65,000.00	0.05
342	002310	东方园林	15,700	64,998.00	0.05
343	000560	我爱我家	15,700	63,742.00	0.05
344	002091	江苏国泰	8,800	63,624.00	0.05
345	002468	申通快递	6,200	62,496.00	0.05
346	002640	跨境通	12,100	62,194.00	0.05
347	000156	华数传媒	7,200	61,632.00	0.05
348	002635	安洁科技	3,500	60,305.00	0.04
349	002399	海普瑞	3,494	60,166.68	0.04
350	000789	万年青	4,510	59,983.00	0.04
351	300735	光弘科技	4,380	59,787.00	0.04
352	300666	江丰电子	1,200	59,412.00	0.04
353	300682	朗新科技	4,050	59,211.00	0.04
354	002912	中新赛克	1,020	59,119.20	0.04
355	002010	传化智联	12,500	58,875.00	0.04
356	002035	华帝股份	6,600	58,278.00	0.04
357	002375	亚厦股份	7,800	58,032.00	0.04
358	002292	奥飞娱乐	9,300	56,637.00	0.04
359	300616	尚品宅配	700	55,762.00	0.04
360	000582	北部湾港	5,300	55,650.00	0.04
361	002847	盐津铺子	500	55,110.00	0.04
362	002351	漫步者	4,100	55,022.00	0.04
363	300633	开立医疗	2,100	54,306.00	0.04
364	002302	西部建设	6,000	52,680.00	0.04
365	002815	崇达技术	3,600	51,984.00	0.04
366	002434	万里扬	5,600	49,952.00	0.04
367	000869	张裕A	1,118	48,744.80	0.04
368	300602	飞荣达	2,411	48,605.76	0.04
369	000031	大悦城	10,900	47,960.00	0.04
370	300257	开山股份	3,500	47,775.00	0.04
371	001965	招商公路	6,900	47,541.00	0.04
372	300324	旋极信息	10,900	46,107.00	0.03
373	002918	蒙娜丽莎	1,300	41,990.00	0.03
374	000062	深圳华强	3,200	39,808.00	0.03
375	002320	海峡股份	4,200	38,262.00	0.03
376	002901	大博医疗	500	36,865.00	0.03
377	002653	海思科	2,100	36,792.00	0.03
378	000553	安道麦A	4,700	36,754.00	0.03
379	000810	创维数字	4,500	35,955.00	0.03
380	002532	天山铝业	4,700	35,579.00	0.03
381	002051	中工国际	5,000	35,450.00	0.03

382	002461	珠江啤酒	3,200	34,208.00	0.03
383	002419	天虹股份	4,300	32,852.00	0.02
384	000785	居然之家	3,100	26,009.00	0.02
385	001872	招商港口	1,600	25,472.00	0.02
386	300634	彩讯股份	1,200	22,224.00	0.02
387	000826	启迪环境	80	540.80	0.00

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300880	迦南智能	3,732	129,612.36	0.10
2	002407	多氟多	6,400	128,192.00	0.10
3	300894	火星人	2,344	112,028.95	0.08
4	300869	康泰医学	862	95,578.56	0.07
5	300925	法本信息	1,834	84,583.72	0.06
6	002589	瑞康医药	12,200	63,806.00	0.05
7	002449	国星光电	5,980	60,996.00	0.05
8	002668	奥马电器	10,218	40,463.28	0.03
9	300896	爱美客	52	31,374.72	0.02
10	300926	博俊科技	2,837	30,526.12	0.02
11	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.02
12	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.02
13	002497	雅化集团	900	19,755.00	0.01
14	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.01
15	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.01
16	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.01
17	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.01
18	300877	金春股份	251	12,763.35	0.01
19	300872	天阳科技	310	11,730.40	0.01
20	300913	兆龙互连	486	11,634.84	0.01
21	300879	大叶股份	426	11,553.12	0.01
22	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.01
23	003023	彩虹集团	296	11,262.80	0.01
24	300900	广联航空	334	11,075.44	0.01
25	300876	蒙泰高新	280	10,253.60	0.01
26	300919	中伟股份	159	9,780.09	0.01
27	300893	松原股份	276	9,682.08	0.01
28	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.01
29	300878	维康药业	189	9,208.08	0.01
30	300861	美畅股份	179	9,146.90	0.01
31	300887	谱尼测试	117	8,718.84	0.01
32	300860	锋尚文化	64	8,106.88	0.01
33	300873	海晨股份	194	8,016.08	0.01

34	300868	杰美特	178	7,703.84	0.01
35	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.01
36	300884	狄耐克	215	7,204.65	0.01
37	002108	沧州明珠	1,329	7,150.02	0.01
38	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
39	300910	瑞丰新材	135	6,462.45	0.00
40	002258	利尔化学	300	6,270.00	0.00
41	300922	天秦装备	198	6,252.84	0.00
42	300918	南山智尚	677	6,052.38	0.00
43	000016	深康佳A	900	5,949.00	0.00
44	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00
45	300908	仲景食品	93	5,620.92	0.00
46	300323	华灿光电	400	4,868.00	0.00
47	300911	亿田智能	143	4,727.58	0.00
48	300055	万邦达	700	4,235.00	0.00
49	300027	华谊兄弟	933	4,011.90	0.00
50	000539	粤电力A	900	3,492.00	0.00
51	002251	步步高	400	3,380.00	0.00
52	300199	翰宇药业	500	3,325.00	0.00
53	000910	大亚圣象	200	2,792.00	0.00
54	300504	天邑股份	100	1,843.00	0.00
55	300409	道氏技术	100	1,493.00	0.00
56	002016	世荣兆业	200	1,364.00	0.00
57	002168	ST 惠程	200	850.00	0.00
58	000503	国新健康	100	836.00	0.00
59	000426	兴业矿业	100	784.00	0.00

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	000333	美的集团	2,855,945.00	2.01
2	300750	宁德时代	2,329,931.00	1.64
3	000651	格力电器	2,173,662.00	1.53
4	000858	五粮液	1,983,692.48	1.40
5	300122	智飞生物	1,799,539.60	1.27
6	000661	长春高新	1,767,838.00	1.25
7	002352	顺丰控股	1,733,670.00	1.22
8	300059	东方财富	1,717,985.00	1.21
9	300142	沃森生物	1,694,272.61	1.19
10	002410	广联达	1,605,964.80	1.13
11	002714	牧原股份	1,584,821.00	1.12
12	300498	温氏股份	1,567,184.00	1.11

13	000725	京东方 A	1,463,866.00	1.03
14	000002	万 科 A	1,385,062.58	0.98
15	002414	高德红外	1,319,789.00	0.93
16	002007	华兰生物	1,303,548.00	0.92
17	002027	分众传媒	1,234,145.00	0.87
18	000932	华菱钢铁	1,223,182.00	0.86
19	002602	世纪华通	1,216,745.00	0.86
20	000895	双汇发展	1,183,931.47	0.83

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	000333	美的集团	5,572,233.55	3.93
2	000858	五 粮 液	4,311,505.76	3.04
3	000651	格力电器	3,761,318.00	2.65
4	300750	宁德时代	3,630,268.00	2.56
5	000661	长春高新	2,675,198.00	1.89
6	300059	东方财富	2,381,857.00	1.68
7	300498	温氏股份	2,283,718.00	1.61
8	000002	万 科 A	2,163,638.00	1.53
9	002475	立讯精密	2,122,420.00	1.50
10	000725	京东方 A	1,993,279.00	1.41
11	300760	迈瑞医疗	1,976,793.00	1.39
12	000001	平安银行	1,965,748.00	1.39
13	300142	沃森生物	1,961,470.00	1.38
14	002352	顺丰控股	1,944,537.00	1.37
15	002714	牧原股份	1,917,744.00	1.35
16	300122	智飞生物	1,842,571.05	1.30
17	002415	海康威视	1,812,289.00	1.28
18	002410	广联达	1,808,489.08	1.28
19	002027	分众传媒	1,690,991.00	1.19
20	002007	华兰生物	1,617,482.00	1.14

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	199,509,078.25
卖出股票收入（成交）总额	258,514,533.03

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

8.7 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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内，基金投资的前十名证券中的发行主体中没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出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	11,303.13
2	应收证券清算款	2,796,775.85
3	应收股利	-

4	应收利息	764.20
5	应收申购款	48,350.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,857,193.96

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

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

无。

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	300880	迦南智能	129,612.36	0.10	首发流通受限
2	300869	康泰医学	95,578.56	0.07	首发流通受限
3	300894	火星人	8,687.95	0.01	首发流通受限
4	300925	法本信息	6,868.72	0.01	首发流通受限

§ 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 (%)
融通深证成份指数 A/B	6,082	14,958.40	198,051.80	0.22	90,778,940.53	99.78
融通深证成份指数 C	2,453	4,652.28	4,159,733.78	36.45	7,252,308.08	63.55
合计	8,535	11,996.37	4,357,785.58	4.26	98,031,248.61	95.74

9.2 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	融通深证成份指数 A/B	45,432.19	0.0499
	融通深证成份指数 C	104.84	0.0009

有本基金	合计	45,537.03	0.0445
------	----	-----------	--------

9.3 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

§ 10 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	150,432,951.81	4,398,315.57
本报告期基金总申购份额	44,121,535.82	37,659,164.25
减：本报告期基金总赎回份额	103,577,495.30	30,645,437.96
本报告期期末基金份额总额	90,976,992.33	11,412,041.86

§ 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 基金管理人的重大变动

2020年6月22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的公告》，经本基金管理人第六届董事会第四次定期会议审议通过，决定由邹曦先生担任公司副总经理职务。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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。

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

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。本基金本年度应支付的审计费用为人民币 40,000.00 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	
长江证券	1	289,164,768.32	63.59%	263,517.05	63.61%	-
天风证券	1	60,268,859.86	13.25%	54,923.15	13.26%	-
海通证券	1	46,002,900.80	10.12%	41,784.12	10.09%	-
华泰证券	1	26,880,638.85	5.91%	24,496.59	5.91%	-
中泰证券	3	20,710,492.34	4.55%	18,873.61	4.56%	-
中信证券	1	8,829,950.64	1.94%	8,046.55	1.94%	-
开源证券	1	2,799,823.80	0.62%	2,551.51	0.62%	-
安信证券	1	52,041.09	0.01%	47.41	0.01%	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-

平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的标准包括以下六个方面：

- (1) 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

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

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

3、交易单元变更情况

本报告期内，本基金新增华金证券、新时代证券、开源证券、万联证券各 1 个交易单元，终止长城证券 1 个交易单元。西藏东方财富更名为东方财富，终止中信证券(华南)(原广州证券) 1 个交易单元。

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
长江证券	589,911.82	49.67%	-	-	-	-
天风证券	6,567.71	0.55%	-	-	-	-
海通证券	569,251.36	47.93%	-	-	-	-
华泰证券	21,925.37	1.85%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国农业银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2020-01-04
2	融通关于旗下部分开放式基金新增深圳市金海九州基金销售有限公司为销售机构并开通转换业务及参加其费率优惠的公告	证券时报、管理人网站	2020-01-16
3	融通基金管理有限公司关于调整旗下基金2020年春节假期申购赎回等交易业务及清算交收安排的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和管理人网站	2020-01-30
4	融通基金新增玄元保险为销售机构并开通定投、转换及参与其费率优惠的公告	证券时报、管理人网站	2020-02-20
5	融通关于旗下部分开放式基金参加万家财	证券时报、管理人网站	2020-02-21

	富申购费率优惠活动的公告		
6	融通关于旗下部分开放式基金在中国邮政储蓄银行开通基金定期定额投资和转换业务的公告	证券时报、管理人网站	2020-03-05
7	融通关于旗下部分开放式基金参加中国国际期货有限公司申购费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2020-03-13
8	融通关于旗下部分开放式基金在北京植信基金销售有限公司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	2020-03-24
9	关于旗下部分开放式基金参与华安证券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	2020-05-06
10	融通关于旗下部分开放式基金新增和耕传承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	2020-05-15
11	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加万联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并开通基金转换业务的公告	证券时报、管理人网站	2020-05-18
12	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加恒泰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	2020-06-19
13	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和管理人网站	2020-06-22
14	融通关于旗下部分开放式基金在工行开通基金转换业务的公告	证券时报、管理人网站	2020-06-24
15	关于融通基金管理有限公司旗下基金参与中信建投证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和管理人网站	2020-06-29
16	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	2020-06-30
17	融通关于旗下部分开放式基金新增泛华普益基金销售有限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参加其费率优惠的公告	证券时报、管理人网站	2020-07-02
18	融通关于旗下部分开放式基金在北京银行股份有限公司开通基金转换业务的公告	证券时报、管理人网站	2020-07-14
19	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加海通证券股份有限公司申购及定期定额申购业务费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2020-07-24
20	融通关于旗下部分开放式基金参加渤海银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2020-07-31

21	融通基金管理有限公司关于新增中国人寿保险股份有限公司为销售机构并开通定期定额申购、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	2020-08-03
22	融通关于旗下部分开放式基金参加北京展恒基金销售股份有限公司申购费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2020-08-05
23	融通关于旗下部分开放式基金参加中信银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2020-08-07
24	融通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增安信证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资、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	2020-09-16
25	融通关于旗下部分开放式基金参加中国银行申购费率及定期定额申购费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2020-09-18
26	关于融通基金管理有限公司旗下部分基金在国泰君安证券股份有限公司开通转换业务的公告	证券时报、管理人网站	2020-10-28
27	融通关于旗下部分开放式基金参加和讯信息科技有限公司申购费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2020-11-17
28	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	2020-12-28
29	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邮政储蓄银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2020-12-28
30	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行股份有限公司“2021 倾心回馈”基金定期定额投资费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2020-12-28
31	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 2021 年全年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	2020-12-28

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准融通深证成份指数证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通深证成份指数证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通深证成份指数证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通深证成份指数证券投资基金招募说明书》及其更新

(五) 融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照

(六) 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

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

融通基金管理有限公司

2021 年 3 月 30 日