

融通深证成份指数证券投资基金

2021 年中期报告

2021 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：2021 年 8 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期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 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	11
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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 中期财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	49

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 .....	49
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 .....	49
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 .....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	49
7.12 投资组合报告附注 .....	50
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	51
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 .....	51
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>51</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	52
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 .....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	52
10.4 基金投资策略的改变 .....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	52
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 .....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	52
10.8 其他重大事件 .....	55
<b>§ 11 备查文件目录 .....</b>	<b>56</b>
11.1 备查文件目录 .....	56
11.2 存放地点 .....	56
11.3 查阅方式 .....	56

## § 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	85,845,604.76 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	78,666,619.22 份	7,178,985.54 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金中期报告备置地点	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、15 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(2021年1月1日-2021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	10,942,838.79	1,079,198.57	
本期利润	8,904,119.09	915,197.52	
加权平均基金份额本期利润	0.1067	0.1123	
本期加权平均净值利润率	8.14%	8.54%	
本期基金份额净值增长率	7.78%	7.56%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)		
	期末可供分配利润	30,616,081.59	787,851.75
	期末可供分配基金份额利润	0.3892	0.1097
	期末基金资产净值	109,282,700.81	10,009,206.87
	期末基金份额净值	1.389	1.394
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)		
	基金份额累计净值增长率	44.07%	61.16%

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

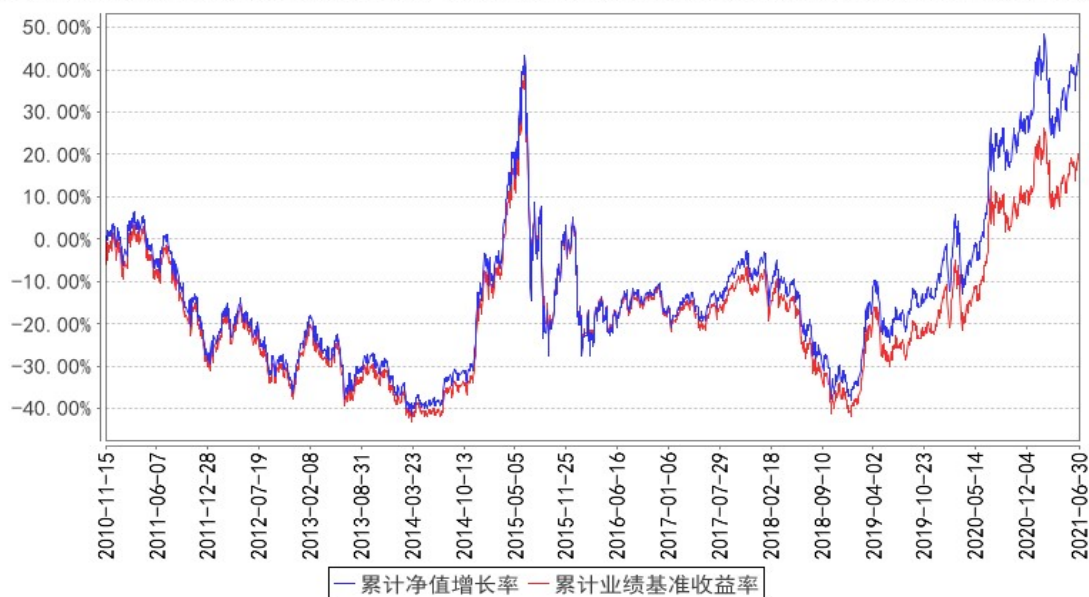
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.21%	1.04%	1.05%	0.98%	1.16%	0.06%
过去三个月	12.74%	1.08%	9.54%	1.02%	3.20%	0.06%
过去六个月	7.78%	1.44%	4.60%	1.37%	3.18%	0.07%
过去一年	33.58%	1.45%	25.14%	1.40%	8.44%	0.05%
过去三年	79.86%	1.51%	58.57%	1.48%	21.29%	0.03%
自基金合同生效起至今	44.07%	1.57%	20.25%	1.52%	23.82%	0.05%

融通深证成份指数 C

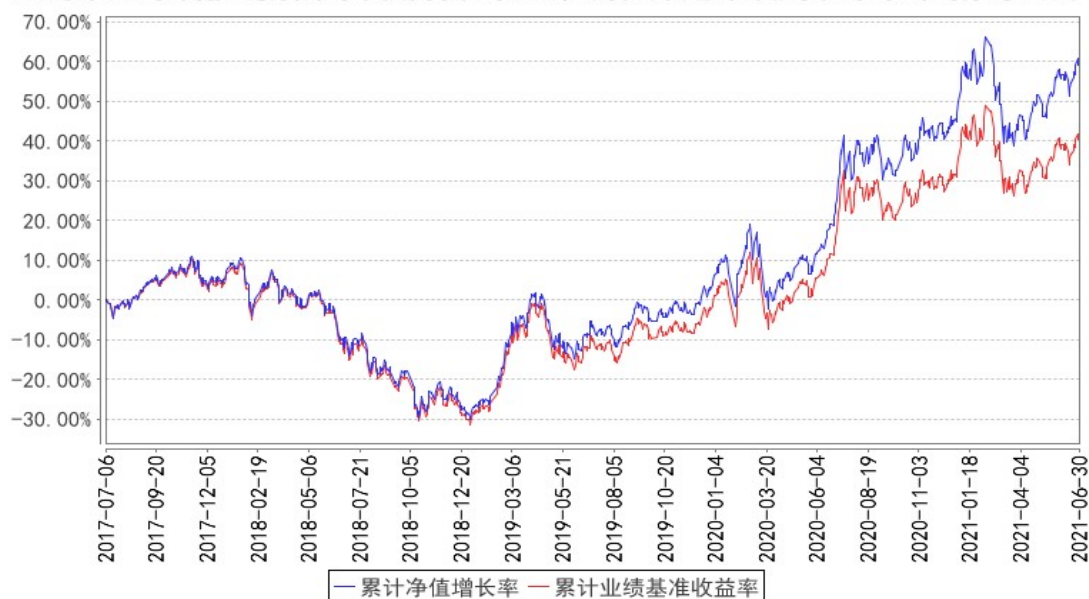
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.20%	1.04%	1.05%	0.98%	1.15%	0.06%
过去三个月	12.69%	1.07%	9.54%	1.02%	3.15%	0.05%
过去六个月	7.56%	1.44%	4.60%	1.37%	2.96%	0.07%
过去一年	33.14%	1.45%	25.14%	1.40%	8.00%	0.05%
过去三年	77.81%	1.51%	58.57%	1.48%	19.24%	0.03%
自基金合同生效起至今	61.16%	1.42%	41.81%	1.40%	19.35%	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。

## § 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 2021 年 6 月 30 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)、融通产业趋势精选 2 年封闭运作混合型证券投资基金、融通价值趋势混合型证券投资基金、融通核心趋势混合型证券投资基金。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	2016-11-19	-	10	蔡志伟先生，计算机应用技术硕士，金融风险管理师（FRM），10 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、融通量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

交易执行、业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。

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

报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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 1.389 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.78%；截至本报告期末融通深证成份指数 C 基金份额净值为 1.394 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.56%；同期业绩比较基准收益率为 4.60%。

#### 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 年下半年，从海内外宏观经济来看，随着下半年新冠疫苗接种提高，疫情扰动边际减弱，2021 年全球经济共振复苏大趋势延续。从国内经济来看，中国经济今年有望迎来高增长，一方面国内经济内生增长动力增强，另一方面出口将维持强劲增长，预计全年 GDP 有望达到 8% 以上。从政策的角度来看，由于海外疫情影响还未完全消退，海外货币政策仍处宽松阶段，因此我国货币政策空间仍较大，7 月全面降准预示下半年稳健货币政策或仍将延续。从企业盈利角度看，受益于全球共振式复苏，A 股全年有望实现 20% 的高增长。从资金面的角度看，居民资金正趋势性入场，21 年预计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，货币保持稳健的环境下，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。

#### 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、适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经公司总经理办公会议审批后方可实施。基金在采用新投资策略或投资新品种时，应评价现有估值政策和程序的适用性。其中研究部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，金融工程小组负责估值方法的研究、价格的计算及复核，登记清算部进行具体的估值核算并与基金托管人核对，同时负责对外进行信息披露。监察稽核部负责基金估值业务的事前、事中及事后的审核工作。

截至本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签订服务协议，由其提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人于 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。

#### 4.8 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。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 托管人对本中期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 2021 年中期报告中财务指标、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 中期财务会计报告（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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,572,891.77	7,398,788.44
结算备付金		114,864.28	121,378.90
存出保证金		9,977.64	11,303.13
交易性金融资产	6.4.7.2	116,117,848.97	126,963,272.59
其中：股票投资		113,095,405.18	126,963,272.59
基金投资		-	-
债券投资		3,022,443.79	-
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		457,192.23	2,796,775.85
应收利息	6.4.7.5	13,868.75	764.20
应收股利		-	-
应收申购款		135,352.27	48,350.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		120,421,995.91	137,340,633.89
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		860,040.84	2,011,822.04
应付管理人报酬		96,889.60	112,635.32
应付托管费		19,377.92	22,527.08
应付销售服务费		3,302.37	4,857.90
应付交易费用	6.4.7.7	69,317.53	120,613.55
应交税费		-	0.02

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	81,159.97	161,346.66
负债合计		1,130,088.23	2,433,802.57
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	85,845,604.76	102,389,034.19
未分配利润	6.4.7.10	33,446,302.92	32,517,797.13
所有者权益合计		119,291,907.68	134,906,831.32
负债和所有者权益总计		120,421,995.91	137,340,633.89

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 85,845,604.76 份，其中融通深证成份指数 A/B 基金份额总额为 78,666,619.22 份，基金份额净值 1.389 元；融通深证成份指数 C 基金份额总额为 7,178,985.54 份，基金份额净值 1.394 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		10,892,479.17	22,108,853.29
1. 利息收入		18,546.11	69,910.04
其中：存款利息收入	6.4.7.11	11,560.61	10,840.81
债券利息收入		6,985.50	59,069.23
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		13,034,045.29	13,011,725.90
其中：股票投资收益	6.4.7.12	12,407,765.45	11,874,415.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	46,691.38	77,496.86
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	579,588.46	1,059,813.55
3. 公允价值变动收益	6.4.7.17	-2,202,720.75	8,962,182.99
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	6.4.7.18	42,608.52	65,034.36
减：二、费用		1,073,162.56	1,240,341.94
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	598,265.20	687,165.02

2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	119, 653. 02	137, 433. 06
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	21, 394. 89	14, 810. 50
4. 交易费用	6. 4. 7. 19	254, 332. 24	321, 196. 09
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0. 05	0. 15
7. 其他费用	6. 4. 7. 20	79, 517. 16	79, 737. 12
三、利润总额		9, 819, 316. 61	20, 868, 511. 35
减：所得税费用		-	-
四、净利润		9, 819, 316. 61	20, 868, 511. 35

### 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	102, 389, 034. 19	32, 517, 797. 13	134, 906, 831. 32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9, 819, 316. 61	9, 819, 316. 61
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-16, 543, 429. 43	-6, 027, 967. 30	-22, 571, 396. 73
其中：1. 基金申购款	19, 103, 759. 77	5, 954, 969. 69	25, 058, 729. 46
2. 基金赎回款	-35, 647, 189. 20	-11, 982, 936. 99	-47, 630, 126. 19
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-2, 862, 843. 52	-2, 862, 843. 52
五、期末所有者权益（基金净值）	85, 845, 604. 76	33, 446, 302. 92	119, 291, 907. 68
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	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）	-	20, 868, 511. 35	20, 868, 511. 35
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-28, 537, 768. 30	167, 354. 77	-28, 370, 413. 53
其中：1. 基金申购款	40, 348, 346. 63	-2, 059, 477. 56	38, 288, 869. 07
2. 基金赎回款	-68, 886, 114. 93	2, 226, 832. 33	-66, 659, 282. 60
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）	126, 293, 499. 08	8, 010, 378. 02	134, 303, 877. 10

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：

张帆

颜锡廉

刘美丽

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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 X95%+银行活期存款利率 X5%。



#### 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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 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[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。

#### 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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	3,572,891.77
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	3,572,891.77

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	86,978,469.90	113,095,405.18	26,116,935.28
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	3,023,246.30	3,022,443.79
	银行间市场	-	-
	合计	3,023,246.30	3,022,443.79
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	90,001,716.20	116,117,848.97	26,116,132.77

**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**

无。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	264.56
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	46.53
应收债券利息	13,553.61
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	4.05
合计	13,868.75

**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 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	69,317.53
银行间市场应付交易费用	-
合计	69,317.53

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,816.81
应付证券出借违约金	-
预提费用	79,343.16

合计	81,159.97
----	-----------

## 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 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	90,976,992.33	90,976,992.33
本期申购	12,561,078.82	12,561,078.82
本期赎回	-24,871,451.93	-24,871,451.93
本期末	78,666,619.22	78,666,619.22

## 融通深证成份指数 C

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,412,041.86	11,412,041.86
本期申购	6,542,680.95	6,542,680.95
本期赎回	-10,775,737.27	-10,775,737.27
本期末	7,178,985.54	7,178,985.54

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。

## 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	43,168,157.11	-14,026,009.49	29,142,147.62
本期利润	10,942,838.79	-2,038,719.70	8,904,119.09
本期基金份额交易产生的变动数	-6,344,646.29	1,777,304.69	-4,567,341.60
其中：基金申购款	6,476,329.20	-2,613,376.28	3,862,952.92
基金赎回款	-12,820,975.49	4,390,680.97	-8,430,294.52
本期已分配利润	-2,862,843.52	-	-2,862,843.52
本期末	44,903,506.09	-14,287,424.50	30,616,081.59

## 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	-189,083.55	3,564,733.06	3,375,649.51
本期利润	1,079,198.57	-164,001.05	915,197.52
本期基金份额交易产生的变动数	-102,263.27	-1,358,362.43	-1,460,625.70
其中：基金申购款	354,787.49	1,737,229.28	2,092,016.77
基金赎回款	-457,050.76	-3,095,591.71	-3,552,642.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	787,851.75	2,042,369.58	2,830,221.33

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	10,421.80
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	1,050.34
其他	88.47
合计	11,560.61

## 6.4.7.12 股票投资收益

## 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	12,407,765.45
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	12,407,765.45

## 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	93,317,803.46
减：卖出股票成本总额	80,910,038.01
买卖股票差价收入	12,407,765.45

## 6.4.7.13 债券投资收益

## 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券(、债转股及债券到期兑付)差价收入	46,691.38
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	46,691.38

## 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	193,705.63
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	146,999.29
减：应收利息总额	14.96
买卖债券差价收入	46,691.38

## 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 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	579,588.46
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	579,588.46

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,202,720.75
股票投资	-2,201,918.24
债券投资	-802.51
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	-2,202,720.75

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
----	----------------------------

基金赎回费收入	40,424.59
基金转换费收入	2,183.93
合计	42,608.52

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。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	254,332.24
银行间市场交易费用	-
合计	254,332.24

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	174.00
合计	79,517.16

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，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

无。

## 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 2021年1月1日至 2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至 2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	598,265.20	687,165.02
其中：支付销售机构的客户维护费	277,916.79	288,387.91

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。

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至 2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至 2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	119,653.02	137,433.06

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。

## 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 2021年1月1日至2021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	-	4,677.86	4,677.86
合计	-	4,677.86	4,677.86
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	-	218.11	218.11
合计	-	218.11	218.11

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。

#### 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自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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	3,572,891.77	10,421.80	4,889,274.09	9,652.78

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 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

融通深证成份指数 A/B								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基金份 额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2021-1-19	-	2021-1-19	0.3300	1,401,675.66	1,461,167.86	2,862,843.52	-
合计	-	-	-	0.3300	1,401,675.66	1,461,167.86	2,862,843.52	-

## 6.4.12 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通日	流通受限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单 位：股)	期末 成本总额	期末估值总额	备注
300614	百川畅银	2021-5-18	2021-11-25	首发流通受限	9.19	40.38	240	2,205.60	9,691.20	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-7-7	首发流通受限	10.76	22.2	284	3,055.84	6,304.80	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-7-7	首发流通受限	13.39	30.1	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021-1-12	2021-7-20	首发流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300930	屹通新材	2021-1-13	2021-7-21	首发流通受限	13.11	24.48	278	3,644.58	6,805.44	-
300931	通用电梯	2021-1-13	2021-7-21	首发流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300932	三友联众	2021-1-15	2021-7-22	首发流通受限	24.69	31.71	222	5,481.18	7,039.62	-
300933	中辰股份	2021-1-15	2021-7-22	首发流通受限	3.37	10.44	944	3,181.28	9,855.36	-
300937	药易购	2021-1-20	2021-7-27	首发流通受限	12.25	53.71	226	2,768.50	12,138.46	-
300941	创识科技	2021-2-2	2021-8-9	首发流通受限	21.31	49.94	182	3,878.42	9,089.08	-
300942	易瑞生物	2021-2-2	2021-8-9	首发流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021-2-3	2021-8-10	首发流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021-2-3	2021-8-10	首发流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-2-18	2021-8-25	首发流通受限	13.00	27.42	197	2,561.00	5,401.74	-
300948	冠中生态	2021-6-4	2021-8-25	流通受限	0.00	27.42	99	0.00	2,714.58	-
300950	德固特	2021-2-24	2021-9-3	首发流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021-3-3	2021-9-13	首发流通受限	11.72	27.08	227	2,660.44	6,147.16	-
300953	震裕科技	2021-3-11	2021-9-22	首发流通受限	28.77	99.85	120	3,452.40	11,982.00	-
300955	嘉亨家化	2021-3-16	2021-9-24	首发流通受限	16.53	46.07	154	2,545.62	7,094.78	-
300956	英力股份	2021-3-16	2021-9-27	首发流通受限	12.85	25.8	238	3,058.30	6,140.40	-
300957	贝泰妮	2021-3-18	2021-9-27	首发流通受限	47.33	251.96	78	3,691.74	19,652.88	-
300958	建工修复	2021-3-18	2021-9-29	首发流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021-3-22	2021-9-29	首发流通受限	12.08	23.06	219	2,645.52	5,050.14	-
300961	深水海纳	2021-3-23	2021-9-30	首发流通受限	8.48	22.07	271	2,298.08	5,980.97	-
300962	中金辐照	2021-3-29	2021-10-11	首发流通受限	3.4	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300966	共同药业	2021-3-31	2021-10-11	首发流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300968	格林精密	2021-4-6	2021-10-15	首发流通受限	6.87	12.07	452	3,105.24	5,455.64	-
300971	博亚精工	2021-4-7	2021-10-15	首发流通受限	18.24	28.29	188	3,429.12	5,318.52	-

300973	立高食品	2021-4-8	2021-10-15	首发流通受限	28.28	115.71	93	2,630.04	10,761.03	-
300975	商络电子	2021-4-14	2021-10-21	首发流通受限	5.48	13.03	457	2,504.36	5,954.71	-
300978	东箭科技	2021-4-15	2021-10-26	首发流通受限	8.42	13.6	408	3,435.36	5,548.80	-
300979	华利集团	2021-4-15	2021-10-26	首发流通受限	33.22	87.5	139	4,617.58	12,162.50	-
300981	中红医疗	2021-4-19	2021-10-27	首发流通受限	48.59	90.39	78	3,790.02	7,050.42	-
300982	苏文电能	2021-4-19	2021-10-27	首发流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300986	志特新材	2021-4-21	2021-11-1	首发流通受限	14.79	30.57	127	1,878.33	3,882.39	-
300987	川网传媒	2021-4-28	2021-11-11	首发流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300991	创益通	2021-5-12	2021-11-22	首发流通受限	13.06	26.51	227	2,964.62	6,017.77	-
300992	泰福泵业	2021-5-17	2021-11-25	首发流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021-5-17	2021-11-24	首发流通受限	12.1	19.29	272	3,291.20	5,246.88	-
300995	奇德新材	2021-5-17	2021-11-26	首发流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021-5-26	2021-12-3	首发流通受限	20.81	42.23	162	3,371.22	6,841.26	-
300997	欢乐家	2021-5-26	2021-12-2	首发流通受限	4.94	13.05	533	2,633.02	6,955.65	-
300998	宁波方正	2021-5-25	2021-12-2	首发流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021-5-27	2021-12-7	首发流通受限	18.71	57.62	136	2,544.56	7,836.32	-
301004	嘉益股份	2021-6-18	2021-12-27	首发流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301007	德迈仕	2021-6-4	2021-12-16	首发流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301010	晶雪节能	2021-6-9	2021-12-20	首发流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021-6-9	2021-12-17	首发流通受限	14.2	33.84	162	2,300.40	5,482.08	-
301012	扬电科技	2021-6-15	2021-12-22	首发流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301015	百洋医药	2021-6-22	2021-12-30	首发流通受限	7.64	38.83	308	2,353.12	11,959.64	-
301016	雷尔伟	2021-6-23	2021-12-30	首发流通受限	13.75	32.98	195	2,681.25	6,431.10	-
301020	密封科技	2021-6-28	2021-7-6	首发流通受限	10.64	10.64	2,593	27,589.52	27,589.52	-
301020	密封科技	2021-6-28	2022-1-6	首发流通受限	10.64	10.64	289	3,074.96	3,074.96	-
301021	英诺激光	2021-6-28	2021-7-6	首发流通受限	9.46	9.46	1,985	18,778.10	18,778.10	-
301021	英诺激光	2021-6-28	2022-1-6	首发流通受限	9.46	9.46	221	2,090.66	2,090.66	-

## 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
127038	国微转债	2021-6-10	2021-7-14	新债未上市	100.00	100.00	96	9,599.96	9,599.96	-

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。

#### 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

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 2021 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 0.02%(2020 年 12 月 31 日：无)。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	2,994,898.20	-
合计	2,994,898.20	-

注：未评级部分为国债。

**6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

**6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无。

**6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	27,545.59	-
未评级	-	-
合计	27,545.59	-

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

无。

**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 2021 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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，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%。于 2021 年 6 月 30 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。截止 2021 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、存出保证金和债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	3,572,891.77	-	-	-	3,572,891.77
结算备付金	114,864.28	-	-	-	114,864.28
存出保证金	9,977.64	-	-	-	9,977.64
交易性金融资产	2,994,898.20	-	27,545.59	113,095,405.18	116,117,848.97
应收利息	-	-	-	13,868.75	13,868.75
应收申购款	-	-	-	135,352.27	135,352.27
应收证券清算款	-	-	-	457,192.23	457,192.23
资产总计	6,692,631.89	-	27,545.59	113,701,818.43	120,421,995.91
负债					
应付赎回款	-	-	-	860,040.84	860,040.84
应付管理人报酬	-	-	-	96,889.60	96,889.60
应付托管费	-	-	-	19,377.92	19,377.92
应付销售服务费	-	-	-	3,302.37	3,302.37
应付交易费用	-	-	-	69,317.53	69,317.53
其他负债	-	-	-	81,159.97	81,159.97
负债总计	-	-	-	1,130,088.23	1,130,088.23
利率敏感度缺口	6,692,631.89	-	27,545.59	112,571,730.20	119,291,907.68
上年度末 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

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 2021 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 2.53% (2020 年 12 月 31 日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2020 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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	113,095,405.18	94.81	126,963,272.59	94.11
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	113,095,405.18	94.81	126,963,272.59	94.11

#### 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 (2021 年 6 月 30 日)	上年度末 (2020 年 12 月 31 日)
	深证成份指数收益率上升 5%	5,971,148.31	6,512,359.72
	深证成份指数收益率下降 5%	-5,971,148.31	-6,512,359.72

#### 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	113,095,405.18	93.92
	其中：股票	113,095,405.18	93.92

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,022,443.79	2.51
	其中：债券	3,022,443.79	2.51
	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	3,687,756.05	3.06
8	其他各项资产	616,390.89	0.51
9	合计	120,421,995.91	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,634,330.36	1.37
B	采矿业	640,477.47	0.54
C	制造业	84,381,325.82	70.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	502,789.00	0.42
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	815,456.07	0.68
G	交通运输、仓储和邮政业	804,166.00	0.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,800,611.34	5.70
J	金融业	8,070,580.41	6.77
K	房地产业	1,872,937.21	1.57
L	租赁和商务服务业	1,109,046.34	0.93
M	科学研究和技术服务业	1,280,114.00	1.07
N	水利、环境和公共设施管理业	73,353.00	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	236,057.00	0.20
Q	卫生和社会工作	3,134,278.98	2.63
R	文化、体育和娱乐业	701,700.00	0.59
S	综合	277,704.00	0.23
	合计	112,334,927.00	94.17

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	753.00	0.00
C	制造业	629,245.11	0.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	14,356.93	0.01
F	批发和零售业	41,945.93	0.04

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	32,228.92	0.03
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,274.00	0.00
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	37,362.14	0.03
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	3,312.15	0.00
S	综合	-	-
	合计	760,478.18	0.64

### 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	9,900	5,294,520.00	4.44
2	000858	五粮液	15,746	4,690,575.94	3.93
3	000333	美的集团	42,203	3,012,028.11	2.52
4	300059	东方财富	72,715	2,384,324.85	2.00
5	002415	海康威视	34,835	2,246,857.50	1.88
6	000651	格力电器	41,002	2,136,204.20	1.79
7	300760	迈瑞医疗	3,900	1,872,195.00	1.57
8	000001	平安银行	79,409	1,796,231.58	1.51
9	002475	立讯精密	38,357	1,764,422.00	1.48
10	002594	比亚迪	6,944	1,742,944.00	1.46
11	000568	泸州老窖	7,043	1,661,725.42	1.39
12	300015	爱尔眼科	21,551	1,529,689.98	1.28
13	000725	京东方A	244,998	1,528,787.52	1.28
14	300122	智飞生物	6,800	1,269,764.00	1.06
15	002142	宁波银行	31,394	1,223,424.18	1.03
16	000002	万科A	51,200	1,219,072.00	1.02
17	300124	汇川技术	16,147	1,199,076.22	1.01
18	300014	亿纬锂能	11,078	1,151,336.54	0.97
19	002230	科大讯飞	16,963	1,146,359.54	0.96
20	002714	牧原股份	18,275	1,111,485.50	0.93
21	300782	卓胜微	1,940	1,042,750.00	0.87
22	300347	泰格医药	5,250	1,014,825.00	0.85
23	000661	长春高新	2,594	1,003,878.00	0.84

24	002304	洋河股份	4,835	1,001,812.00	0.84
25	002460	赣锋锂业	7,950	962,665.50	0.81
26	300274	阳光电源	8,260	950,395.60	0.80
27	002271	东方雨虹	16,843	931,754.76	0.78
28	002812	恩捷股份	3,800	889,580.00	0.75
29	002241	歌尔股份	20,214	863,946.36	0.72
30	000063	中兴通讯	25,677	853,246.71	0.72
31	002027	分众传媒	89,664	843,738.24	0.71
32	300142	沃森生物	13,300	820,610.00	0.69
33	000100	TCL 科技	104,320	798,048.00	0.67
34	002352	顺丰控股	10,600	717,620.00	0.60
35	002129	中环股份	18,300	706,380.00	0.59
36	002410	广联达	10,300	702,460.00	0.59
37	002311	海大集团	8,440	688,704.00	0.58
38	000338	潍柴动力	37,240	665,478.80	0.56
39	002709	天赐材料	6,176	658,238.08	0.55
40	000799	酒鬼酒	2,500	639,000.00	0.54
41	002821	凯莱英	1,600	596,160.00	0.50
42	002049	紫光国微	3,700	570,503.00	0.48
43	300759	康龙化成	2,600	564,174.00	0.47
44	300496	中科创达	3,500	549,710.00	0.46
45	300454	深信服	2,100	544,908.00	0.46
46	300595	欧普康视	5,180	536,389.00	0.45
47	002371	北方华创	1,900	527,022.00	0.44
48	300413	芒果超媒	7,640	524,104.00	0.44
49	300012	华测检测	16,000	510,080.00	0.43
50	002179	中航光电	6,442	509,046.84	0.43
51	300450	先导智能	8,241	495,613.74	0.42
52	000538	云南白药	4,142	479,312.24	0.40
53	300003	乐普医疗	14,100	452,892.00	0.38
54	000625	长安汽车	16,697	438,797.16	0.37
55	300207	欣旺达	13,102	426,601.12	0.36
56	300408	三环集团	9,750	413,595.00	0.35
57	002648	卫星石化	10,360	406,008.40	0.34
58	300498	温氏股份	27,678	397,732.86	0.33
59	300601	康泰生物	2,600	387,400.00	0.32
60	000776	广发证券	24,760	374,866.40	0.31
61	002050	三花智控	15,483	371,282.34	0.31
62	002074	国轩高科	8,300	361,548.00	0.30
63	000166	申万宏源	77,120	360,921.60	0.30
64	002841	视源股份	2,900	360,441.00	0.30
65	300037	新宙邦	3,600	360,360.00	0.30

66	002340	格林美	38,510	360,068.50	0.30
67	002493	荣盛石化	19,825	342,377.75	0.29
68	002920	德赛西威	3,100	341,248.00	0.29
69	300433	蓝思科技	11,560	339,979.60	0.28
70	300146	汤臣倍健	10,300	338,870.00	0.28
71	002001	新和成	11,721	336,158.28	0.28
72	002223	鱼跃医疗	8,800	335,544.00	0.28
73	002601	龙佰集团	9,700	335,426.00	0.28
74	300751	迈为股份	720	327,384.00	0.27
75	300725	药石科技	2,040	324,176.40	0.27
76	300285	国瓷材料	6,600	321,750.00	0.27
77	300529	健帆生物	3,710	320,395.60	0.27
78	002414	高德红外	11,498	317,114.84	0.27
79	300896	爱美客	400	315,552.00	0.26
80	300724	捷佳伟创	2,700	313,227.00	0.26
81	002236	大华股份	14,832	312,955.20	0.26
82	002568	百润股份	3,280	310,911.20	0.26
83	000963	华东医药	6,699	308,220.99	0.26
84	300763	锦浪科技	1,700	307,020.00	0.26
85	300661	圣邦股份	1,200	303,276.00	0.25
86	002250	联化科技	10,800	301,320.00	0.25
87	002064	华峰化学	21,200	301,040.00	0.25
88	300999	金龙鱼	3,542	300,928.32	0.25
89	000768	中航西飞	11,360	298,540.80	0.25
90	000786	北新建材	7,596	298,143.00	0.25
91	000895	双汇发展	9,317	296,280.60	0.25
92	002008	大族激光	7,300	294,847.00	0.25
93	000830	鲁西化工	15,700	294,061.00	0.25
94	002185	华天科技	18,534	285,238.26	0.24
95	002007	华兰生物	7,685	281,885.80	0.24
96	000009	中国宝安	15,200	277,704.00	0.23
97	002511	中顺洁柔	10,000	275,500.00	0.23
98	002202	金风科技	22,088	268,590.08	0.23
99	000301	东方盛虹	12,800	267,520.00	0.22
100	002736	国信证券	24,800	266,600.00	0.22
101	002092	中泰化学	25,800	264,966.00	0.22
102	002624	完美世界	11,000	263,010.00	0.22
103	000938	紫光股份	11,875	259,825.00	0.22
104	300316	晶盛机电	5,120	258,560.00	0.22
105	300623	捷捷微电	6,800	257,244.00	0.22
106	002555	三七互娱	10,600	254,612.00	0.21
107	000012	南玻A	24,000	245,760.00	0.21

108	000596	古井贡酒	1,000	239,500.00	0.20
109	002123	梦网科技	13,100	236,586.00	0.20
110	002607	中公教育	11,300	236,057.00	0.20
111	000157	中联重科	25,541	235,998.84	0.20
112	000977	浪潮信息	8,364	235,279.32	0.20
113	300474	景嘉微	2,400	235,008.00	0.20
114	000516	国际医学	12,400	233,244.00	0.20
115	002384	东山精密	11,150	232,366.00	0.19
116	002625	光启技术	11,100	230,991.00	0.19
117	300253	卫宁健康	14,185	230,789.95	0.19
118	000783	长江证券	31,025	227,103.00	0.19
119	300677	英科医疗	1,800	224,640.00	0.19
120	000066	中国长城	15,328	223,788.80	0.19
121	002459	晶澳科技	4,500	220,500.00	0.18
122	300638	广和通	4,700	219,490.00	0.18
123	002044	美年健康	24,000	218,640.00	0.18
124	002727	一心堂	6,600	218,526.00	0.18
125	002138	顺络电子	5,600	217,112.00	0.18
126	002797	第一创业	30,320	216,484.80	0.18
127	002405	四维图新	14,700	216,090.00	0.18
128	300136	信维通信	6,995	216,005.60	0.18
129	000988	华工科技	9,100	214,032.00	0.18
130	000876	新希望	14,400	211,248.00	0.18
131	000887	中鼎股份	17,400	210,192.00	0.18
132	000547	航天发展	11,100	209,457.00	0.18
133	002967	广电计量	4,700	205,860.00	0.17
134	300726	宏达电子	2,900	204,421.00	0.17
135	300033	同花顺	1,800	203,004.00	0.17
136	002353	杰瑞股份	4,451	198,959.70	0.17
137	002252	上海莱士	26,500	198,485.00	0.17
138	000728	国元证券	23,990	191,200.30	0.16
139	002600	领益智造	20,800	191,152.00	0.16
140	000703	恒逸石化	15,922	190,267.90	0.16
141	300628	亿联网络	2,250	188,550.00	0.16
142	002508	老板电器	4,000	186,000.00	0.16
143	002444	巨星科技	5,400	184,032.00	0.15
144	000807	云铝股份	15,400	183,260.00	0.15
145	300699	光威复材	2,388	181,368.60	0.15
146	002497	雅化集团	7,900	179,962.00	0.15
147	002030	达安基因	8,420	178,840.80	0.15
148	000860	顺鑫农业	4,200	177,156.00	0.15
149	001979	招商蛇口	16,163	176,984.85	0.15

150	002156	通富微电	7,300	175,492.00	0.15
151	002013	中航机电	17,370	174,915.90	0.15
152	002791	坚朗五金	900	174,645.00	0.15
153	300073	当升科技	3,100	174,189.00	0.15
154	002439	启明星辰	5,900	171,159.00	0.14
155	002180	纳思达	5,300	170,660.00	0.14
156	002212	天融信	8,500	168,045.00	0.14
157	300458	全志科技	1,907	167,167.62	0.14
158	300308	中际旭创	4,320	166,406.40	0.14
159	002078	太阳纸业	12,400	165,540.00	0.14
160	000039	中集集团	9,100	165,438.00	0.14
161	002402	和而泰	6,900	165,393.00	0.14
162	000630	铜陵有色	60,500	164,560.00	0.14
163	002422	科伦药业	8,216	163,909.20	0.14
164	002385	大北农	24,050	163,540.00	0.14
165	300223	北京君正	1,600	161,472.00	0.14
166	002938	鹏鼎控股	4,500	161,460.00	0.14
167	002747	埃斯顿	4,100	160,105.00	0.13
168	002080	中材科技	6,060	158,590.20	0.13
169	002507	涪陵榨菜	4,200	158,172.00	0.13
170	000513	丽珠集团	3,158	157,963.16	0.13
171	002463	沪电股份	10,200	157,794.00	0.13
172	002916	深南电路	1,393	154,804.09	0.13
173	000708	中信特钢	7,370	153,590.80	0.13
174	003816	中国广核	57,300	152,991.00	0.13
175	002075	沙钢股份	13,700	149,467.00	0.13
176	300832	新产业	2,400	147,840.00	0.12
177	300357	我武生物	2,301	147,540.12	0.12
178	300088	长信科技	17,700	146,202.00	0.12
179	002409	雅克科技	1,800	145,800.00	0.12
180	300001	特锐德	4,800	144,528.00	0.12
181	000423	东阿阿胶	4,000	143,640.00	0.12
182	000021	深科技	7,500	143,550.00	0.12
183	000050	深天马 A	10,100	143,218.00	0.12
184	300618	寒锐钴业	1,808	142,542.72	0.12
185	002603	以岭药业	4,868	141,950.88	0.12
186	002373	千方科技	8,500	141,950.00	0.12
187	000932	华菱钢铁	21,380	141,108.00	0.12
188	002465	海格通信	14,830	140,291.80	0.12
189	000825	太钢不锈	18,700	140,063.00	0.12
190	300115	长盈精密	6,779	139,647.40	0.12
191	000983	山西焦煤	16,800	139,608.00	0.12



192	300463	迈克生物	3,300	138,897.00	0.12
193	300383	光环新网	9,600	138,144.00	0.12
194	300244	迪安诊断	3,600	137,880.00	0.12
195	300009	安科生物	9,216	137,318.40	0.12
196	002028	思源电气	4,400	135,476.00	0.11
197	002541	鸿路钢构	2,300	134,205.00	0.11
198	002706	良信股份	5,939	133,865.06	0.11
199	000975	银泰黄金	14,072	133,824.72	0.11
200	000960	锡业股份	8,300	133,049.00	0.11
201	002152	广电运通	10,175	132,580.25	0.11
202	000069	华侨城 A	17,544	130,527.36	0.11
203	002673	西部证券	15,748	129,921.00	0.11
204	002273	水晶光电	8,800	129,272.00	0.11
205	300482	万孚生物	1,980	128,086.20	0.11
206	002065	东华软件	16,100	127,673.00	0.11
207	300296	利亚德	16,300	127,466.00	0.11
208	300747	锐科激光	1,100	125,466.00	0.11
209	000998	隆平高科	7,800	125,112.00	0.10
210	300685	艾德生物	1,200	124,896.00	0.10
211	000723	美锦能源	16,300	123,228.00	0.10
212	300630	普利制药	2,335	122,354.00	0.10
213	002151	北斗星通	2,800	120,596.00	0.10
214	002926	华西证券	12,500	120,375.00	0.10
215	000623	吉林敖东	7,700	119,273.00	0.10
216	300558	贝达药业	1,100	119,064.00	0.10
217	300271	华宇软件	6,173	118,830.25	0.10
218	002436	兴森科技	10,800	118,800.00	0.10
219	002572	索菲亚	4,900	118,580.00	0.10
220	002690	美亚光电	2,100	117,096.00	0.10
221	000878	云南铜业	9,102	116,778.66	0.10
222	000425	徐工机械	18,300	116,571.00	0.10
223	002985	北摩高科	1,180	115,050.00	0.10
224	300373	扬杰科技	1,900	115,026.00	0.10
225	002557	洽洽食品	2,641	113,827.10	0.10
226	300118	东方日升	5,800	112,520.00	0.09
227	002626	金达威	2,500	111,750.00	0.09
228	000591	太阳能	17,800	110,894.00	0.09
229	002430	杭氧股份	3,200	110,688.00	0.09
230	002966	苏州银行	14,800	108,780.00	0.09
231	002683	宏大爆破	3,900	108,303.00	0.09
232	002958	青农商行	25,200	107,856.00	0.09
233	000997	新大陆	6,500	107,835.00	0.09

234	300144	宋城演艺	6,400	107,520.00	0.09
235	002025	航天电器	2,121	106,410.57	0.09
236	300058	蓝色光标	17,522	106,008.10	0.09
237	000738	航发控制	5,051	105,212.33	0.09
238	300379	东方通	3,680	104,843.20	0.09
239	300346	南大光电	2,700	104,436.00	0.09
240	300017	网宿科技	17,700	103,545.00	0.09
241	000027	深圳能源	11,200	102,704.00	0.09
242	300054	鼎龙股份	5,600	102,200.00	0.09
243	002756	永兴材料	1,700	100,963.00	0.08
244	002408	齐翔腾达	8,100	100,602.00	0.08
245	002390	信邦制药	9,500	99,560.00	0.08
246	002429	兆驰股份	16,400	99,548.00	0.08
247	002506	协鑫集成	28,600	99,528.00	0.08
248	300773	拉卡拉	3,500	98,805.00	0.08
249	002294	信立泰	3,000	98,700.00	0.08
250	000933	神火股份	10,400	98,280.00	0.08
251	002597	金禾实业	2,800	97,160.00	0.08
252	002389	航天彩虹	4,400	96,052.00	0.08
253	002268	卫士通	4,900	95,452.00	0.08
254	000158	常山北明	8,300	95,367.00	0.08
255	000060	中金岭南	21,041	95,105.32	0.08
256	002372	伟星新材	4,600	95,082.00	0.08
257	002831	裕同科技	3,200	95,008.00	0.08
258	300777	中简科技	2,100	94,878.00	0.08
259	002675	东诚药业	4,500	94,815.00	0.08
260	002558	巨人网络	7,100	94,430.00	0.08
261	300476	胜宏科技	4,300	93,955.00	0.08
262	002595	豪迈科技	3,500	93,450.00	0.08
263	002195	二三四五	45,700	92,771.00	0.08
264	002153	石基信息	3,920	92,159.20	0.08
265	300775	三角防务	2,400	91,680.00	0.08
266	002056	横店东磁	7,000	91,000.00	0.08
267	002643	万润股份	5,100	90,678.00	0.08
268	002851	麦格米特	2,900	90,567.00	0.08
269	002221	东华能源	8,200	89,790.00	0.08
270	002032	苏泊尔	1,400	89,306.00	0.07
271	002281	光迅科技	3,600	88,560.00	0.07
272	300294	博雅生物	2,400	86,760.00	0.07
273	000709	河钢股份	34,900	85,854.00	0.07
274	000999	华润三九	3,200	85,600.00	0.07
275	002010	传化智联	11,000	84,810.00	0.07

276	300298	三诺生物	2,700	84,564.00	0.07
277	002925	盈趣科技	2,170	84,434.70	0.07
278	000902	新洋丰	5,400	84,402.00	0.07
279	300348	长亮科技	4,600	84,180.00	0.07
280	000778	新兴铸管	22,600	84,072.00	0.07
281	002191	劲嘉股份	7,900	84,056.00	0.07
282	002048	宁波华翔	4,300	83,850.00	0.07
283	002396	星网锐捷	3,900	83,265.00	0.07
284	300451	创业慧康	9,385	82,963.40	0.07
285	300326	凯利泰	6,000	81,540.00	0.07
286	300502	新易盛	2,601	81,281.25	0.07
287	000488	晨鸣纸业	9,850	80,179.00	0.07
288	002146	荣盛发展	14,200	80,088.00	0.07
289	300567	精测电子	1,300	79,820.00	0.07
290	002004	华邦健康	12,800	79,488.00	0.07
291	000883	湖北能源	17,300	79,407.00	0.07
292	002023	海特高新	5,300	79,076.00	0.07
293	002745	木林森	5,900	79,060.00	0.07
294	000800	一汽解放	7,300	78,986.00	0.07
295	000718	苏宁环球	9,500	78,755.00	0.07
296	300369	绿盟科技	4,900	78,155.00	0.07
297	300803	指南针	2,000	77,200.00	0.06
298	000729	燕京啤酒	10,600	76,744.00	0.06
299	300748	金力永磁	2,400	75,912.00	0.06
300	300456	赛微电子	2,500	75,375.00	0.06
301	002242	九阳股份	2,300	74,727.00	0.06
302	000970	中科三环	7,800	74,490.00	0.06
303	002183	怡亚通	13,000	74,490.00	0.06
304	002563	森马服饰	6,200	74,090.00	0.06
305	002266	浙富控股	14,700	73,353.00	0.06
306	002936	郑州银行	19,910	73,069.70	0.06
307	002203	海亮股份	6,800	72,352.00	0.06
308	000034	神州数码	3,300	72,105.00	0.06
309	002867	周大生	3,600	71,172.00	0.06
310	002128	露天煤业	6,800	70,788.00	0.06
311	002262	恩华药业	4,600	70,610.00	0.06
312	300226	上海钢联	1,180	70,269.00	0.06
313	000400	许继电气	5,500	69,630.00	0.06
314	300188	美亚柏科	4,000	69,600.00	0.06
315	000930	中粮科技	7,700	69,377.00	0.06
316	002701	奥瑞金	13,420	68,978.80	0.06
317	000403	派林生物	2,200	68,464.00	0.06

318	300002	神州泰岳	14,100	68,385.00	0.06
319	300376	易事特	8,300	66,732.00	0.06
320	002249	大洋电机	12,700	66,675.00	0.06
321	002368	太极股份	3,300	66,198.00	0.06
322	002110	三钢闽光	9,800	66,052.00	0.06
323	300674	宇信科技	3,520	65,788.80	0.06
324	002531	天顺风能	7,600	65,740.00	0.06
325	002705	新宝股份	2,500	65,625.00	0.06
326	001914	招商积余	3,800	65,284.00	0.05
327	000898	鞍钢股份	14,600	64,970.00	0.05
328	002773	康弘药业	2,800	64,764.00	0.05
329	002839	张家港行	11,900	64,736.00	0.05
330	300457	赢合科技	3,200	63,552.00	0.05
331	000987	越秀金控	5,000	63,300.00	0.05
332	300616	尚品宅配	700	61,957.00	0.05
333	002481	双塔食品	5,300	61,268.00	0.05
334	000990	诚志股份	4,700	59,831.00	0.05
335	000758	中色股份	12,500	59,375.00	0.05
336	002217	合力泰	16,600	59,262.00	0.05
337	002038	双鹭药业	5,600	58,968.00	0.05
338	002237	恒邦股份	5,100	58,599.00	0.05
339	000681	视觉中国	4,500	58,185.00	0.05
340	000555	神州信息	3,900	56,433.00	0.05
341	002100	天康生物	6,300	56,133.00	0.05
342	000739	普洛药业	1,900	55,860.00	0.05
343	300459	金科文化	17,100	55,233.00	0.05
344	002155	湖南黄金	7,045	54,598.75	0.05
345	300841	康华生物	200	53,760.00	0.05
346	300633	开立医疗	1,700	53,686.00	0.05
347	001965	招商公路	7,300	52,706.00	0.04
348	300113	顺网科技	4,000	51,760.00	0.04
349	300180	华峰超纤	10,400	51,480.00	0.04
350	002440	闰土股份	5,800	51,330.00	0.04
351	300741	华宝股份	1,000	50,720.00	0.04
352	300866	安克创新	300	50,241.00	0.04
353	300666	江丰电子	1,000	49,870.00	0.04
354	002244	滨江集团	11,800	49,442.00	0.04
355	000951	中国重汽	1,800	48,708.00	0.04
356	300770	新媒股份	1,000	48,700.00	0.04
357	000717	韶钢松山	10,100	46,359.00	0.04
358	000028	国药一致	1,187	44,916.08	0.04
359	002351	漫步者	3,300	44,682.00	0.04

360	000078	海王生物	13,500	44,010.00	0.04
361	300682	朗新科技	2,600	43,732.00	0.04
362	000921	海信家电	3,000	43,110.00	0.04
363	300257	开山股份	3,000	43,110.00	0.04
364	002434	万里扬	5,200	42,172.00	0.04
365	002847	盐津铺子	400	39,888.00	0.03
366	000961	中南建设	6,700	39,664.00	0.03
367	300783	三只松鼠	800	37,888.00	0.03
368	002583	海能达	7,500	37,800.00	0.03
369	000937	冀中能源	9,600	37,728.00	0.03
370	002918	蒙娜丽莎	1,200	37,668.00	0.03
371	000959	首钢股份	6,700	37,654.00	0.03
372	000869	张裕A	1,000	37,140.00	0.03
373	002978	安宁股份	600	36,252.00	0.03
374	002532	天山铝业	4,100	34,399.00	0.03
375	002461	珠江啤酒	3,100	33,914.00	0.03
376	001872	招商港口	2,000	33,840.00	0.03
377	300861	美畅股份	400	33,724.00	0.03
378	002945	华林证券	2,400	33,168.00	0.03
379	000031	大悦城	9,200	33,120.00	0.03
380	002912	中新赛克	800	32,776.00	0.03
381	002653	海思科	1,500	32,280.00	0.03
382	300702	天宇股份	900	31,878.00	0.03
383	300768	迪普科技	800	30,904.00	0.03
384	000553	安道麦A	3,300	30,591.00	0.03
385	002901	大博医疗	400	29,156.00	0.02
386	000600	建投能源	5,900	28,969.00	0.02
387	002948	青岛银行	5,800	28,826.00	0.02
388	300869	康泰医学	400	28,328.00	0.02
389	000539	粤电力A	7,400	27,824.00	0.02
390	002959	小熊电器	400	26,576.00	0.02
391	002946	新乳业	1,500	22,725.00	0.02
392	002984	森麒麟	600	21,870.00	0.02
393	003012	东鹏控股	1,300	21,632.00	0.02
394	002793	罗欣药业	2,100	20,937.00	0.02
395	002755	奥赛康	1,500	20,385.00	0.02
396	002961	瑞达期货	900	19,188.00	0.02
397	300251	光线传媒	1,100	11,891.00	0.01

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

1	300894	火星人	2,344	159,392.00	0.13
2	002668	奥马电器	10,218	56,301.18	0.05
3	301020	密封科技	2,882	30,664.48	0.03
4	300919	中伟股份	159	25,917.00	0.02
5	001207	联科科技	682	22,581.02	0.02
6	301021	英诺激光	2,206	20,868.76	0.02
7	300957	贝泰妮	78	19,652.88	0.02
8	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
9	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
10	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.01
11	300979	华利集团	139	12,162.50	0.01
12	300937	药易购	226	12,138.46	0.01
13	300953	震裕科技	120	11,982.00	0.01
14	301015	百洋医药	308	11,959.64	0.01
15	300973	立高食品	93	10,761.03	0.01
16	300933	中辰股份	944	9,855.36	0.01
17	300614	百川畅银	240	9,691.20	0.01
18	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.01
19	300941	创识科技	182	9,089.08	0.01
20	300966	共同药业	286	9,020.44	0.01
21	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.01
22	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.01
23	300950	德固特	219	8,569.47	0.01
24	300925	法本信息	313	8,228.77	0.01
25	300958	建工修复	300	8,166.00	0.01
26	300948	冠中生态	296	8,116.32	0.01
27	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.01
28	301002	崧盛股份	136	7,836.32	0.01
29	002258	利尔化学	300	7,740.00	0.01
30	002108	沧州明珠	1,329	7,322.79	0.01
31	300955	嘉亨家化	154	7,094.78	0.01
32	300981	中红医疗	78	7,050.42	0.01
33	300932	三友联众	222	7,039.62	0.01
34	300997	欢乐家	533	6,955.65	0.01
35	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.01
36	300996	普联软件	162	6,841.26	0.01
37	300930	屹通新材	278	6,805.44	0.01
38	300927	江天化学	217	6,531.70	0.01
39	301016	雷尔伟	195	6,431.10	0.01
40	300926	博俊科技	284	6,304.80	0.01
41	300952	恒辉安防	227	6,147.16	0.01
42	300956	英力股份	238	6,140.40	0.01
43	300991	创益通	227	6,017.77	0.01

44	000016	深康佳 A	900	5,994.00	0.01
45	300961	深水海纳	271	5,980.97	0.01
46	300975	商络电子	457	5,954.71	0.00
47	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
48	300978	东箭科技	408	5,548.80	0.00
49	301011	华立科技	162	5,482.08	0.00
50	300968	格林精密	452	5,455.64	0.00
51	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
52	300971	博亚精工	188	5,318.52	0.00
53	300993	玉马遮阳	272	5,246.88	0.00
54	300960	通业科技	219	5,050.14	0.00
55	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
56	300323	华灿光电	400	4,400.00	0.00
57	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
58	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
59	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
60	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
61	300986	志特新材	127	3,882.39	0.00
62	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
63	300027	华谊兄弟	933	3,312.15	0.00
64	002251	步步高	400	2,944.00	0.00
65	300199	翰宇药业	500	2,680.00	0.00
66	300409	道氏技术	100	2,378.00	0.00
67	000910	大亚圣象	200	2,376.00	0.00
68	002016	世荣兆业	200	1,274.00	0.00
69	000426	兴业矿业	100	753.00	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002179	中航光电	1,597,469.00	1.18
2	300750	宁德时代	1,431,577.00	1.06
3	300726	宏达电子	905,442.00	0.67
4	000009	中国宝安	892,959.71	0.66
5	002414	高德红外	815,978.00	0.60
6	300699	光威复材	767,155.00	0.57
7	002791	坚朗五金	764,773.00	0.57
8	000333	美的集团	715,017.00	0.53
9	300759	康龙化成	697,487.00	0.52
10	002352	顺丰控股	690,922.00	0.51
11	000799	酒鬼酒	648,139.00	0.48
12	002594	比亚迪	616,159.00	0.46

13	000661	长春高新	613,587.00	0.45
14	000568	泸州老窖	600,289.00	0.44
15	300782	卓胜微	594,499.00	0.44
16	002415	海康威视	578,020.00	0.43
17	002625	光启技术	562,761.00	0.42
18	002920	德赛西威	553,704.00	0.41
19	002727	一心堂	546,232.00	0.40
20	002648	卫星石化	497,220.00	0.37

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	1,645,043.00	1.22
2	002179	中航光电	1,614,176.00	1.20
3	000333	美的集团	1,212,571.93	0.90
4	000651	格力电器	1,194,469.00	0.89
5	300750	宁德时代	1,141,754.00	0.85
6	002714	牧原股份	1,009,797.00	0.75
7	002594	比亚迪	949,085.00	0.70
8	000009	中国宝安	946,808.60	0.70
9	002352	顺丰控股	946,499.00	0.70
10	000568	泸州老窖	913,149.00	0.68
11	000157	中联重科	830,825.00	0.62
12	002414	高德红外	801,382.00	0.59
13	300699	光威复材	793,074.00	0.59
14	002415	海康威视	787,186.00	0.58
15	300498	温氏股份	766,393.00	0.57
16	000001	平安银行	764,151.00	0.57
17	300059	东方财富	746,045.00	0.55
18	000002	万科A	717,146.00	0.53
19	000338	潍柴动力	714,371.00	0.53
20	000725	京东方A	677,677.00	0.50

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	69,244,088.84
卖出股票收入（成交）总额	93,317,803.46

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



## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	2,994,898.20	2.51
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）	27,545.59	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,022,443.79	2.53

## 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	019654	21 国债 06	29,940	2,994,898.20	2.51
2	127036	三花转债	137	17,945.63	0.02
3	127038	国微转债	96	9,599.96	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

无。

## 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

无。

## 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

无。

## 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

无。

## 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 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

无。

**7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

无。

**7.11.3 本期国债期货投资评价**

无。

**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、处罚的情形。**

本基金投资的前十名证券中的平安银行，其发行主体为平安银行股份有限公司。

2021 年 5 月 28 日，中国银保监会云南监管局向平安银行股份有限公司做出了行政处罚决定（云银保监罚决字（2021）34 号），依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项，就其利用来源于本行授信的固定资产贷款和黄金租赁融资的资金发放委托贷款，用于承接处置本行其他贷款风险等违法违规行为，决定罚款合计 210 万元。

投资决策说明：本基金依照法律法规及基金合同的约定，采取指数化投资策略，紧密跟踪标的指数。

**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	9,977.64
2	应收证券清算款	457,192.23
3	应收股利	-
4	应收利息	13,868.75
5	应收申购款	135,352.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	616,390.89

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

无。

**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**

无。

**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**

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	301020	密封科技	30,664.48	0.03	首发流通受限

## § 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	5,798	13,567.89	-	-	78,666,619.22	100.00
融通深证成份指数 C	2,240	3,204.90	1,296,203.51	18.06	5,882,782.03	81.94
合计	8,038	10,679.97	1,296,203.51	1.51	84,549,401.25	98.49

### 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	39,194.69	0.0498
	融通深证成份指数 C	93.28	0.0013
	合计	39,287.97	0.0458

### 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	90,976,992.33	11,412,041.86
本报告期基金总申购份额	12,561,078.82	6,542,680.95
减：本报告期基金总赎回份额	24,871,451.93	10,775,737.27

本报告期末基金份额总额	78,666,619.22	7,178,985.54
-------------	---------------	--------------

## § 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 基金管理人的重大变动

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

#### 10.2.2 基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

### 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	
野村东方证券	1	56,129,996.26	34.86%	51,151.40	34.86%	-
长江证券	1	52,437,296.32	32.57%	47,786.05	32.57%	-
东兴证券	1	44,656,645.38	27.74%	40,696.37	27.74%	-

海通证券	1	6,648,693.73	4.13%	6,058.92	4.13%	-
开源证券	1	1,127,493.62	0.70%	1,027.48	0.70%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	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	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中信证券(华南)	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 1 个野村东方证券交易单元。

#### 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
野村东方证券	173,036.26	47.54%	-	-	-	-
长江证券	8,935.92	2.45%	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	170,300.00	46.78%	-	-	-	-
开源证券	11,733.45	3.22%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券(华南)	-	-	-	-	-	-

### 10.8 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	融通深证成份指数证券投资基金第二次分红公告	证券时报、管理人网站	2021-01-13
2	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在上海挖财基金销售有限公司开通定期定额投资业务的公告	证券时报、管理人网站	2021-01-21
3	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	2021-01-25
4	融通关于旗下部分开放式基金参加宁波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	2021-01-27
5	融通关于旗下部分开放式基金新增深圳市前海排排网基金销售有限责任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	2021-03-10
6	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与蚂蚁（杭州）基金销售有限公司费率优惠的公告	证券时报、管理人网站	2021-03-16
7	融通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国中金财富证券有限公司为销售机构并开通定期定额投资及转换业务的公告	证券时报、管理人网站	2021-03-29
8	融通关于旗下部分开放式基金新增上海联泰基金销售有限公司为销售机构和新增开通基金定期定额投资业务的公告	证券时报、管理人网站	2021-03-30
9	融通关于旗下部分开放式基金在上海华夏财富开通定投及参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2021-04-12
10	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与蚂蚁（杭州）基金销售有限公司费率优惠的公告	证券时报、管理人网站	2021-04-14
11	融通关于旗下部分开放式基金参与腾安基金销售（深圳）有限公司费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2021-04-20
12	融通关于旗下部分开放式基金新增上海利得基金销售有限公司为销售机构和新增开通基金定期定额投资业务的公告	证券时报、管理人网站	2021-04-20
13	关于旗下部分开放式基金参与中国国际金融股份有限公司及中国中金财富证券有限公司费率优惠的公告	证券时报、管理人网站	2021-04-27
14	融通关于旗下部分开放式基金参加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司转换费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2021-05-31
15	融通旗下部分开放式基金新增上海中正达广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	2021-06-07
16	关于东方财富证券销售的融通基金旗下部分开放式基金开通定期定额投资业务及参加其费率优惠活动的公	证券时报、管理人网站	2021-06-08

	告		
17	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与上海基煜基金销售有限公司费率优惠的公告	证券时报、管理人网站	2021-06-24
18	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	2021-06-30

## § 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，或登录本基金管理人网站 [www.rtfund.com](http://www.rtfund.com) 查询。

融通基金管理有限公司

2021 年 8 月 27 日