

融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 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巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”) 基金合同规定，于 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

§ 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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
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	10
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
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	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
§ 6 中期财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
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
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	46

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	46
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	46
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	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
§ 8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末上市基金前十名持有人	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	49
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF)	
基金简称	融通巨潮 100 指数 (LOF)	
基金主代码	161607	
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)	
基金合同生效日	2005 年 5 月 12 日	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	580,461,010.29 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2005 年 6 月 16 日	
下属分级基金的基金简称	融通巨潮 100 指数 A/B	融通巨潮 100 指数 C
下属分级基金的场内简称	巨潮 100LOF	-
下属分级基金的交易代码	161607	004874
下属分级基金的前端交易代码	161607	-
下属分级基金的后端交易代码	161657	-
报告期末下属分级基金的份额总额	577,308,794.62 份	3,152,215.67 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	融通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	涂卫东
	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	中国证券报
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、深圳证券交易所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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)	
	融通巨潮 100 指数 A/B	融通巨潮 100 指数 C
本期已实现收益	112,021,597.58	3,124,114.16
本期利润	31,210,147.23	8,273,028.81
加权平均基金份额本期利润	0.0522	0.3395
本期加权平均净值利润率	3.59%	25.28%
本期基金份额净值增长率	2.63%	2.33%
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	118,625,204.37	564,370.38
期末可供分配基金份额利润	0.2055	0.1790
期末基金资产净值	849,161,659.67	4,082,160.94
期末基金份额净值	1.471	1.295
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	594.95%	81.34%

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

融通巨潮 100 指数 A/B

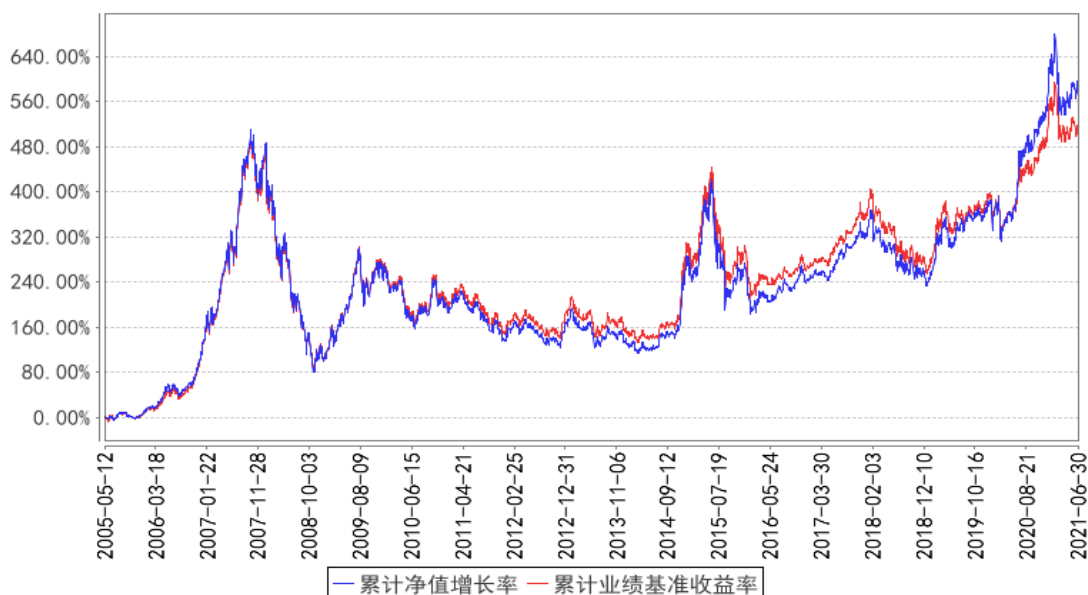
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.20%	0.92%	-2.44%	0.76%	2.64%	0.16%
过去三个月	6.67%	1.09%	1.95%	0.98%	4.72%	0.11%
过去六个月	2.63%	1.50%	-0.62%	1.31%	3.25%	0.19%
过去一年	40.59%	1.39%	27.08%	1.28%	13.51%	0.11%
过去三年	84.57%	1.36%	52.37%	1.29%	32.20%	0.07%
自基金合同生效起至今	594.95%	1.63%	514.81%	1.60%	80.14%	0.03%

融通巨潮 100 指数 C

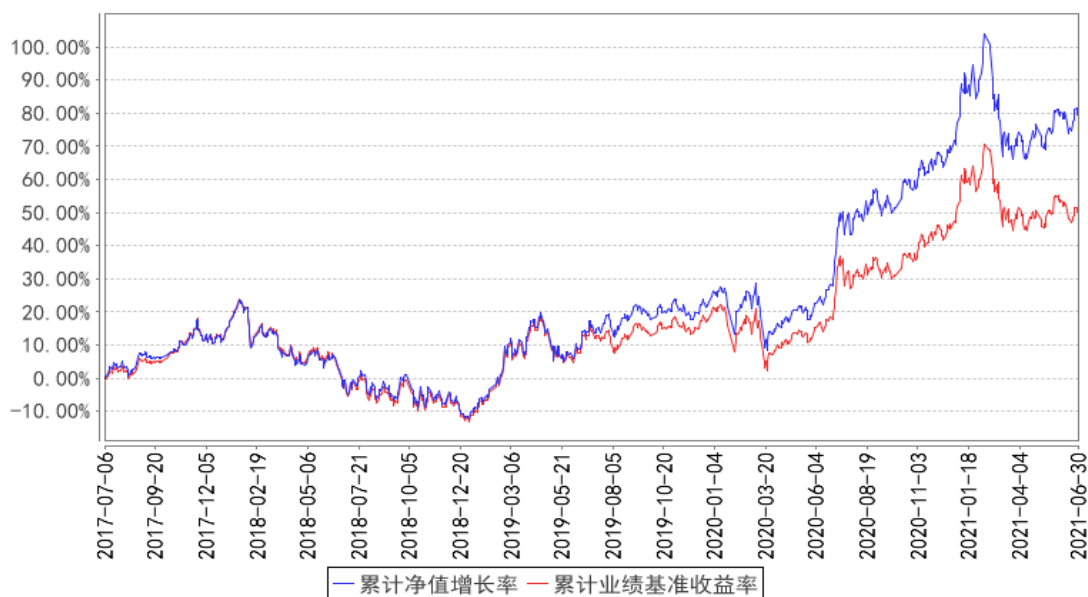
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.15%	0.91%	-2.44%	0.76%	2.59%	0.15%
过去三个月	6.58%	1.09%	1.95%	0.98%	4.63%	0.11%
过去六个月	2.33%	1.50%	-0.62%	1.31%	2.95%	0.19%
过去一年	39.90%	1.39%	27.08%	1.28%	12.82%	0.11%
过去三年	82.17%	1.36%	52.37%	1.29%	29.80%	0.07%
自基金合同生效起至今	81.34%	1.27%	51.06%	1.22%	30.28%	0.05%

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

融通巨潮100指数A/B累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



融通巨潮100指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2017 年 7 月 5 日增设 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	2015 年 2 月 11 日	-	10 年	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、基金业务相关的工作时间为计算标准。

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合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在严格遵守基金合同的前提下实现持有人利益的最大化是本基金管理的核心思想,并将此原则贯彻于基金的运作之中。本基金运用量化投资策略进行指数增强和风险管理,在控制基金相对巨潮100指数基金基准的跟踪误差下,力求最终为投资者带来超越基金基准的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通巨潮 100 指数 A/B 基金份额净值为 1.471 元, 本报告期基金份额净值增长率为 2.63%; 截至本报告期末融通巨潮 100 指数 C 基金份额净值为 1.295 元, 本报告期基金份额净值增长率为 2.33%; 同期业绩比较基准收益率为-0.62%。

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。

具体到本基金跟踪的巨潮 100 指数, 成分股高度集中于长线资金偏好的金融、消费龙头等低估值高分红的企业, 在当前牛市格局下估值仍处较低水平, 预计 2021 年下半年将受益于长线增量资金, 以及追求补涨品种资金的配置需求。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

部进行具体的估值核算并与基金托管人核对，同时负责对外进行信息披露。监察稽核部负责基金估值业务的事前、事中及事后的审核工作。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于 2021 年 1 月 19 日实施 2020 年第二次利润分配，以 2020 年 12 月 31 日的可分配收益为基准，融通巨潮 100 指数 A/B 每 10 份基金份额派发红利 0.263 元，巨潮 100 指数 C 每 10 份基金份额派发红利 0.228 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 的管理人——融通基金管理有限公司在融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对融通基金管理有限公司编制和披露的融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 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：融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF)

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
资产:			
银行存款	6.4.7.1	19,461,496.26	55,751,128.50
结算备付金		1,007,194.10	2,118,894.33
存出保证金		154,410.35	121,305.28
交易性金融资产	6.4.7.2	834,094,387.55	1,015,299,406.33
其中: 股票投资		809,114,914.15	1,015,267,406.61
基金投资		-	-
债券投资		24,979,473.40	31,999.72
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		1,425,124.24	-
应收利息	6.4.7.5	269,628.13	10,377.51
应收股利		-	-
应收申购款		512,657.34	249,133.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		856,924,897.97	1,073,550,244.96
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,428,934.14	1,743,101.12
应付管理人报酬		900,861.82	1,168,795.39
应付托管费		138,594.14	179,814.68
应付销售服务费		1,314.43	45,335.43
应付交易费用	6.4.7.7	820,642.70	900,519.30
应交税费		-	0.06
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	390,730.13	466,456.77
负债合计		3,681,077.36	4,504,022.75
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	580,461,010.29	744,881,503.00
未分配利润	6.4.7.10	272,782,810.32	324,164,719.21

所有者权益合计		853,243,820.61	1,069,046,222.21
负债和所有者权益总计		856,924,897.97	1,073,550,244.96

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 580,461,010.29 份，其中融通巨潮 100 指数 A/B 基金份额总额 577,308,794.62 份，基金份额净值 1.471 元。融通巨潮 100 指数 C 基金份额总额 3,152,215.67 份，基金份额净值 1.295 元。

6.2 利润表

会计主体：融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：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	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		49,378,791.55	47,606,964.17
1. 利息收入		155,831.24	357,993.06
其中：存款利息收入	6.4.7.11	85,874.51	121,171.46
债券利息收入		69,956.73	236,821.60
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		124,775,017.80	16,552,101.01
其中：股票投资收益	6.4.7.12	119,037,348.72	8,054,538.74
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	407,143.95	163,093.26
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
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	5,330,525.13	8,334,469.01
3. 公允价值变动收益	6.4.7.17	-75,662,535.70	30,269,278.07
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	6.4.7.18	110,478.21	427,592.03
减：二、费用		9,895,615.51	10,227,627.91
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,830,094.08	5,979,115.98
2. 托管费	6.4.10.2.2	896,937.56	919,863.95
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	64,784.52	2,735.03
4. 交易费用	6.4.7.19	2,960,676.94	3,177,399.69
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.28	0.42
7. 其他费用	6.4.7.20	143,122.13	148,512.84
三、利润总额		39,483,176.04	37,379,336.26

减：所得税费用		-	-
四、净利润		39,483,176.04	37,379,336.26

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：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）	744,881,503.00	324,164,719.21	1,069,046,222.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	39,483,176.04	39,483,176.04
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-164,420,492.71	-71,826,492.34	-236,246,985.05
其中：1. 基金申购款	41,454,810.01	19,680,463.77	61,135,273.78
2. 基金赎回款	-205,875,302.72	-91,506,956.11	-297,382,258.83
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-19,038,592.59	-19,038,592.59
五、期末所有者权益（基金净值）	580,461,010.29	272,782,810.32	853,243,820.61
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）	1,005,693,210.97	141,961,725.04	1,147,654,936.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	37,379,336.26	37,379,336.26
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-292,113,413.80	-45,152,625.26	-337,266,039.06
其中：1. 基金申购款	52,241,882.24	2,472,502.89	54,714,385.13
2. 基金赎回款	-344,355,296.04	-47,625,128.15	-391,980,424.19
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	713,579,797.17	134,188,436.04	847,768,233.21

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

融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) (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”)证监基金字[2005]第 18 号《关于同意融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 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《融通巨潮 100 指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式,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 513,273,618.60 元,认购资金产生的利息折份额为 253,579.83 份基金份额,基金合同生效日基金份额总额为 513,527,198.43 份,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(2005)第 65 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《融通巨潮 100 指数证券投资基金基金合同》于 2005 年 5 月 12 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 513,527,198.43 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。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2005]第 56 号文审核同意,本基金 188,512,868.00 份基金份额于 2005 年 6 月 16 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

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巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 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 类基金份额;在投资者赎回时收取后端申购费用的份额,称为 B 类基金份额;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 类基金份额。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《融通巨潮 100 指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金为增强型指数基金,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票(含存托凭证)、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金的股票投资部分主要投资于目标指数的成份股票,包括巨潮 100 指数的成份股和预期将要被选入巨潮 100 指数的股票,本基金还可适当投资一级市场的股票(包括新股与增发)。非成份股的投资比例控制在基金资产净值的 10%以内,但成份股更换期因指数成份股调整而进行的非成份股投资不在此比例限制范围之内。为控制基金偏离目标指数的风险,本基金力求将基金份额净值增长率与目标指数增长率间的日跟踪误差控制在 0.5%以内。本基金标的指数使用费由基金管理人融通基金管理有限公司承担,

不计入本基金费用。本基金投资于股票的资产比例范围为基金资产净值的 90%-95%，保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券等短期金融工具的资产比例合计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：巨潮 100 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、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》、《融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 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	19,461,496.26
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	19,461,496.26

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	672,622,612.63	809,114,914.15	136,492,301.52
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	24,999,443.00	-19,969.60
	银行间市场	-	-
	合计	24,999,443.00	-19,969.60
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	697,622,055.63	834,094,387.55	136,472,331.92

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,599.26
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	407.88
应收债券利息	267,558.44
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	62.55
合计	269,628.13

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	820,642.70
银行间市场应付交易费用	-
合计	820,642.70

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	250,000.00
应付赎回费	2,339.00
应付证券出借违约金	-
预提费用	138,391.13
合计	390,730.13

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

融通巨潮 100 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	644,184,661.23	644,184,661.23
本期申购	37,795,645.26	37,795,645.26
本期赎回	-104,671,511.87	-104,671,511.87
本期末	577,308,794.62	577,308,794.62

融通巨潮 100 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	100,696,841.77	100,696,841.77
本期申购	3,659,164.75	3,659,164.75
本期赎回	-101,203,790.85	-101,203,790.85
本期末	3,152,215.67	3,152,215.67

注：1、申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

2、截至 2021 年 6 月 30 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 9,017,268.00 份，均为 A 类基金份额；托管在场外未上市交易的基金份额为 571,443,742.29 份。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注

册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

融通巨潮 100 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	29,680,818.15	265,572,662.04	295,253,480.19
本期利润	112,021,597.58	-80,811,450.35	31,210,147.23
本期基金份额交易产生的变动数	-6,344,306.09	-31,533,551.01	-37,877,857.10
其中：基金申购款	3,457,148.37	15,074,630.00	18,531,778.37
基金赎回款	-9,801,454.46	-46,608,181.01	-56,409,635.47
本期已分配利润	-16,732,905.27	-	-16,732,905.27
本期末	118,625,204.37	153,227,660.68	271,852,865.05

融通巨潮 100 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	4,179,312.03	24,731,926.99	28,911,239.02
本期利润	3,124,114.16	5,148,914.65	8,273,028.81
本期基金份额交易产生的变动数	-4,433,368.49	-29,515,266.75	-33,948,635.24
其中：基金申购款	351,035.45	797,649.95	1,148,685.40
基金赎回款	-4,784,403.94	-30,312,916.70	-35,097,320.64
本期已分配利润	-2,305,687.32	-	-2,305,687.32
本期末	564,370.38	365,574.89	929,945.27

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	74,485.58
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	10,038.37
其他	1,350.56
合计	85,874.51

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	119,037,348.72
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	119,037,348.72

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	1,057,657,161.83
减：卖出股票成本总额	938,619,813.11
买卖股票差价收入	119,037,348.72

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	407,143.95
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	407,143.95

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	1,992,905.39
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,585,590.34
减：应收利息总额	171.10
买卖债券差价收入	407,143.95

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

无。

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	5,330,525.13
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	5,330,525.13

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	-75,662,535.70
股票投资	-75,642,566.10
债券投资	-19,969.60
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	-75,662,535.70

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	108,866.68
基金转换费收入	1,611.53
合计	110,478.21

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的赎回费总额的 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	2,960,676.94
银行间市场交易费用	-

合计	2,960,676.94
----	--------------

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	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	231.00
账户维护费	9,000.00
上市费	29,752.78
合计	143,122.13

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

截至本财务报表报出日，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、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

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

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
新时代证券	-	-	470,736,263.18	24.10

6.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
新时代证券	-	-	-	-
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 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
新时代证券	438,395.43	24.32	85,979.30	9.72

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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	5,830,094.08
其中：支付销售机构的客户维护费	2,167,451.07	701,205.31

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 1.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.30% / 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	896,937.56	919,863.95
----------------	------------	------------

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

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

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		
	融通巨潮 100 指数 A/B	融通巨潮 100 指数 C	合计
融通基金	-	58,098.08	58,098.08
合计	-	58,098.08	58,098.08
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		
	融通巨潮 100 指数 A/B	融通巨潮 100 指数 C	合计
融通基金	-	678.33	678.33
合计	-	678.33	678.33

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：

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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	19,461,496.26	74,485.58	44,809,721.54	102,093.39

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

单位：人民币元

融通巨潮 100 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 年 1 月 19 日	2021 年 1 月 20 日	2021 年 1 月 19 日	0.2630	6,662,989.82	10,069,915.45	16,732,905.27	-
合计	-	-	-	0.2630	6,662,989.82	10,069,915.45	16,732,905.27	-
融通巨潮 100 指数 C								
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 年 1 月 19 日	2021 年 1 月 19 日	2021 年 1 月 19 日	0.2280	2,272,557.89	33,129.43	2,305,687.32	-
合计	-	-	-	0.2280	2,272,557.89	33,129.43	2,305,687.32	-

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 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	首发流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	首发流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	首发流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-

300929	华骐环保	2021 年 1 月 12 日	2021 年 7 月 20 日	首发流通 受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300930	屹通新材	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	首发流通 受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用电梯	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	首发流通 受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300932	三友联众	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	首发流通 受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	首发流通 受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	首发流通 受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300941	创识科技	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	首发流通 受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300942	易瑞生物	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	首发流通 受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	首发流通 受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	首发流通 受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021 年 2 月 18 日	2021 年 8 月 25 日	首发流通 受限	13.00	27.42	216	2,808.00	5,922.72	-
300948	冠中生态	2021 年 6 月 4 日	2021 年 8 月 25 日	流通受限	0.00	27.42	108	0.00	2,961.36	-
300950	德固特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	首发流通 受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 13 日	首发流通 受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕科技	2021 年 3 月 11 日	2021 年 9 月 22 日	首发流通 受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨家化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 24 日	首发流通 受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 27 日	首发流通 受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	首发流通 受限	47.33	251.96	578	27,356.74	145,632.88	-
300958	建工修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	首发流通 受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	首发流通 受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	首发流通 受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021 年 3 月	2021 年 10	首发流通	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-

		29 日	月 11 日	受限						
300966	共同药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	首发流通 受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	首发流通 受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林精密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 15 日	首发流通 受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300971	博亚精工	2021 年 4 月 7 日	2021 年 10 月 15 日	首发流通 受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300973	立高食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	首发流通 受限	28.28	115.7 1	360	10,180.80	41,655.60	-
300975	商络电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	首发流通 受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	首发流通 受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	首发流通 受限	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
300981	中红医疗	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	首发流通 受限	48.59	90.39	566	27,501.94	51,160.74	-
300982	苏文电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	首发流通 受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300986	志特新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	首发流通 受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	首发流通 受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300991	创益通	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	首发流通 受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	首发流通 受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	首发流通 受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	首发流通 受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	首发流通 受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	首发流通 受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	首发流通 受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	首发流通 受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益股份	2021 年 6 月 18 日	2021 年 12 月 27 日	首发流通 受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-

301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	首发流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	首发流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	首发流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	首发流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	首发流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	首发流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	首发流通受限	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	首发流通受限	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	首发流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	首发流通受限	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
600905	三峡能源	2021年6月2日	2021年12月10日	首发流通受限	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	首发流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	首发流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688076	诺泰生物	2021年5月12日	2021年11月22日	首发流通受限	15.57	48.55	4,984	77,600.88	241,973.20	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	首发流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688117	圣诺生物	2021年5月26日	2021年12月3日	首发流通受限	17.90	35.97	1,672	29,928.80	60,141.84	-
688161	威高骨科	2021年6月23日	2021年12月30日	首发流通受限	36.22	82.27	3,069	111,159.18	252,486.63	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	首发流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688269	凯立新材	2021年6月1日	2021年12月9日	首发流通受限	18.94	100.92	1,941	36,762.54	195,885.72	-
688319	欧林生物	2021年5月31日	2021年12月8日	首发流通受限	9.88	27.34	3,412	33,710.56	93,284.08	-
688355	明志科技	2021年4月30日	2021年11月12日	首发流通受限	17.65	23.80	2,710	47,831.50	64,498.00	-
688499	利元亨	2021年6月	2021年7月	首发流通	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-

		23 日	1 日	受限						
688609	九联科技	2021 年 3 月 15 日	2021 年 9 月 23 日	首发流通 受限	3.99	15.29	10,372	41,384.28	158,587.88	-
688616	西力科技	2021 年 3 月 10 日	2021 年 9 月 22 日	首发流通 受限	7.35	13.78	3,918	28,797.30	53,990.04	-
688621	阳光诺和	2021 年 6 月 11 日	2021 年 12 月 21 日	首发流通 受限	26.89	63.99	1,485	39,931.65	95,025.15	-
688663	新风光	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 13 日	首发流通 受限	14.48	19.21	3,279	47,479.92	62,989.59	-
688669	聚石化学	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 26 日	首发流通 受限	36.65	32.39	2,681	98,258.65	86,837.59	-
688686	奥普特	2020 年 12 月 24 日	2021 年 7 月 1 日	首发流通 受限	78.49	451.0 0	2,330	182,881.7 0	1,050,830.00	-
688689	银河微电	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 27 日	首发流通 受限	14.01	35.62	3,258	45,644.58	116,049.96	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股票，自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股票，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股票数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股票不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

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

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上

市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

4、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。

5、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

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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。本基金主要投资于目标指数的成份股票，包括巨潮 100 指数的成份股和预期将要被选入巨潮 100 指数的股票。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。

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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券 (2020 年 12 月 31 日：0.003%)。

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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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公司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

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	19,461,496.26	-	-	-	19,461,496.26
结算备付金	1,007,194.10	-	-	-	1,007,194.10
存出保证金	154,410.35	-	-	-	154,410.35
交易性金融资产	24,979,473.40	-	-	809,114,914.15	834,094,387.55
应收利息	-	-	-	269,628.13	269,628.13
应收申购款	-	-	-	512,657.34	512,657.34
应收证券清算款	-	-	-	1,425,124.24	1,425,124.24
资产总计	45,602,574.11	-	-	811,322,323.86	856,924,897.97
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,428,934.14	1,428,934.14
应付管理人报酬	-	-	-	900,861.82	900,861.82
应付托管费	-	-	-	138,594.14	138,594.14
应付销售服务费	-	-	-	1,314.43	1,314.43
应付交易费用	-	-	-	820,642.70	820,642.70
其他负债	-	-	-	390,730.13	390,730.13
负债总计	-	-	-	3,681,077.36	3,681,077.36
利率敏感度缺口	45,602,574.11	-	-	807,641,246.50	853,243,820.61
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	55,751,128.50	-	-	-	55,751,128.50
结算备付金	2,118,894.33	-	-	-	2,118,894.33
存出保证金	121,305.28	-	-	-	121,305.28
交易性金融资产	-	-	31,999.72	1,015,267,406.61	1,015,299,406.33
应收利息	-	-	-	10,377.51	10,377.51
应收申购款	-	-	-	249,133.01	249,133.01
资产总计	57,991,328.11	-	31,999.72	1,015,526,917.13	1,073,550,244.96
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,743,101.12	1,743,101.12
应付管理人报酬	-	-	-	1,168,795.39	1,168,795.39
应付托管费	-	-	-	179,814.68	179,814.68
应付销售服务费	-	-	-	45,335.43	45,335.43
应付交易费用	-	-	-	900,519.30	900,519.30
应交税费	-	-	-	0.06	0.06
其他负债	-	-	-	466,456.77	466,456.77

负债总计	-	-	-	4,504,022.75	4,504,022.75
利率敏感度缺口	57,991,328.11	-	31,999.72	1,011,022,894.38	1,069,046,222.21

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，本基金未持有交易性债券投资占基金资产净值的比例为 2.93%（2020 年 12 月 31 日：0.003%），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。

本基金以指数化分散投资为主要投资策略，在此基础上进行适度的主动调整，在数量化投资技术与基本面深入研究的结合中谋求基金投资组合在偏离风险及超额收益间的最佳匹配。金融工程小组负责对基金组合的跟踪误差和偏离风险进行评估，定期提交组合跟踪误差归因分析报告和风险监控报告。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。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。本基金投资于股票的资产比例范围为基金资产净值的 90%-95%；保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券等短期金融工具的资产比例合计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。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	809,114,914.15	94.83	1,015,267,406.61	94.97
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	809,114,914.15	94.83	1,015,267,406.61	94.97

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除巨潮 100 指数收益率以外的其他市场变量保持不变		
	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)
分析	巨潮 100 指数收益率上升 5%	46,018,466.23	52,395,653.96
	巨潮 100 指数收益率下降 5%	-46,018,466.23	-52,395,653.96

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	809,114,914.15	94.42
	其中: 股票	809,114,914.15	94.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	24,979,473.40	2.92
	其中: 债券	24,979,473.40	2.92
	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	20,468,690.36	2.39
8	其他各项资产	2,361,820.06	0.28
9	合计	856,924,897.97	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	8,032,132.48	0.94
B	采矿业	11,346,113.70	1.33
C	制造业	425,042,367.61	49.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	206,400.00	0.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,594,870.00	0.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,312,496.00	0.27
J	金融业	218,252,987.75	25.58
K	房地产业	128,574.00	0.02
L	租赁和商务服务业	24,264,154.00	2.84
M	科学研究和技术服务业	20,681,154.48	2.42
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	1,499,902.00	0.18
Q	卫生和社会工作	9,300,225.48	1.09
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	724,661,377.50	84.93

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	5,850.78	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	70,176,457.59	8.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,160,036.60	0.60
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	46,404.58	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	3,771,690.00	0.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,416,739.70	0.52
J	金融业	34,721.10	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	771,826.60	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	44,438.33	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	84,453,536.65	9.90

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	600519	贵州茅台	31,224	64,218,400.80	7.53
2	600036	招商银行	892,633	48,371,782.27	5.67
3	300750	宁德时代	71,900	38,452,120.00	4.51
4	601318	中国平安	544,263	34,985,225.64	4.10
5	000858	五粮液	103,265	30,761,610.85	3.61
6	300059	东方财富	833,501	27,330,497.79	3.20
7	601012	隆基股份	252,420	22,424,992.80	2.63
8	000001	平安银行	948,223	21,448,804.26	2.51
9	603259	药明康德	132,072	20,681,154.48	2.42
10	601888	中国中免	61,720	18,522,172.00	2.17
11	601166	兴业银行	893,847	18,368,555.85	2.15
12	002142	宁波银行	448,616	17,482,565.52	2.05
13	000333	美的集团	227,171	16,213,194.27	1.90
14	002475	立讯精密	337,529	15,526,334.00	1.82
15	002415	海康威视	228,035	14,708,257.50	1.72
16	000568	泸州老窖	53,622	12,651,574.68	1.48
17	002594	比亚迪	49,000	12,299,000.00	1.44
18	300760	迈瑞医疗	24,554	11,787,147.70	1.38
19	600276	恒瑞医药	173,319	11,780,492.43	1.38
20	600887	伊利股份	318,362	11,725,272.46	1.37
21	600030	中信证券	461,500	11,509,810.00	1.35
22	300124	汇川技术	154,500	11,473,170.00	1.34
23	300122	智飞生物	61,400	11,465,222.00	1.34
24	600809	山西汾酒	24,733	11,080,384.00	1.30
25	300014	亿纬锂能	105,400	10,954,222.00	1.28
26	000651	格力电器	198,075	10,319,707.50	1.21
27	603501	韦尔股份	29,900	9,627,800.00	1.13
28	300015	爱尔眼科	131,026	9,300,225.48	1.09
29	600309	万华化学	84,109	9,152,741.38	1.07
30	600438	通威股份	207,300	8,969,871.00	1.05
31	000661	长春高新	22,600	8,746,200.00	1.03
32	000725	京东方A	1,337,700	8,347,248.00	0.98
33	601899	紫金矿业	856,130	8,295,899.70	0.97

34	002714	牧原股份	132,064	8,032,132.48	0.94
35	600104	上汽集团	340,000	7,469,800.00	0.88
36	002304	洋河股份	33,700	6,982,640.00	0.82
37	600436	片仔癀	14,700	6,590,010.00	0.77
38	600019	宝钢股份	822,300	6,282,372.00	0.74
39	600690	海尔智家	226,628	5,871,931.48	0.69
40	002027	分众传媒	610,200	5,741,982.00	0.67
41	000063	中兴通讯	167,200	5,556,056.00	0.65
42	600031	三一重工	178,300	5,183,181.00	0.61
43	601601	中国太保	159,396	4,617,702.12	0.54
44	300433	蓝思科技	155,831	4,582,989.71	0.54
45	601229	上海银行	542,400	4,447,680.00	0.52
46	601633	长城汽车	91,000	3,966,690.00	0.46
47	601288	农业银行	1,270,000	3,848,100.00	0.45
48	600837	海通证券	330,700	3,803,050.00	0.45
49	601818	光大银行	962,520	3,638,325.60	0.43
50	002352	顺丰控股	53,100	3,594,870.00	0.42
51	601688	华泰证券	210,027	3,318,426.60	0.39
52	601658	邮储银行	631,100	3,168,122.00	0.37
53	601857	中国石油	576,600	3,050,214.00	0.36
54	002493	荣盛石化	172,800	2,984,256.00	0.35
55	603288	海天味业	23,019	2,968,300.05	0.35
56	601211	国泰君安	165,248	2,832,350.72	0.33
57	600999	招商证券	138,689	2,637,864.78	0.31
58	600050	中国联通	535,300	2,312,496.00	0.27
59	601628	中国人寿	67,800	2,297,742.00	0.27
60	601169	北京银行	420,500	2,047,835.00	0.24
61	000876	新希望	113,800	1,669,446.00	0.20
62	002607	中公教育	71,800	1,499,902.00	0.18
63	601138	工业富联	91,600	1,136,756.00	0.13
64	300999	金龙鱼	13,100	1,112,976.00	0.13
65	000166	申万宏源	179,770	841,323.60	0.10
66	601336	新华保险	17,300	794,243.00	0.09
67	601066	中信建投	6,600	207,438.00	0.02
68	600900	长江电力	10,000	206,400.00	0.02
69	002736	国信证券	18,200	195,650.00	0.02
70	000002	万科A	5,400	128,574.00	0.02
71	601319	中国人保	10,100	59,893.00	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	300593	新雷能	135,840	5,902,248.00	0.69
2	002709	天赐材料	53,000	5,648,740.00	0.66
3	688007	光峰科技	127,500	5,339,700.00	0.63
4	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.60
5	300782	卓胜微	9,500	5,106,250.00	0.60
6	603659	璞泰来	36,800	5,026,880.00	0.59
7	603486	科沃斯	21,000	4,789,680.00	0.56
8	688696	极米科技	5,700	4,742,400.00	0.56
9	300496	中科创达	27,700	4,350,562.00	0.51
10	002139	拓邦股份	241,100	4,337,389.00	0.51
11	600096	云天化	300,000	4,212,000.00	0.49
12	601636	旗滨集团	226,900	4,211,264.00	0.49
13	300595	欧普康视	39,520	4,092,296.00	0.48
14	000799	酒鬼酒	15,900	4,064,040.00	0.48
15	300623	捷捷微电	100,000	3,783,000.00	0.44
16	601919	中远海控	123,500	3,771,690.00	0.44
17	603678	火炬电子	46,600	3,145,500.00	0.37
18	603806	福斯特	15,000	1,576,950.00	0.18
19	688686	奥普特	2,330	1,050,830.00	0.12
20	688131	皓元医药	1,955	676,801.45	0.08
21	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.05
22	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.04
23	688161	威高骨科	3,069	252,486.63	0.03
24	688076	诺泰生物	4,984	241,973.20	0.03
25	688269	凯立新材	1,941	195,885.72	0.02
26	688609	九联科技	10,372	158,587.88	0.02
27	300957	贝泰妮	578	145,632.88	0.02
28	688689	银河微电	3,258	116,049.96	0.01
29	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
30	688621	阳光诺和	1,485	95,025.15	0.01
31	688319	欧林生物	3,412	93,284.08	0.01
32	688669	聚石化学	2,681	86,837.59	0.01
33	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
34	300979	华利集团	925	80,937.50	0.01
35	688355	明志科技	2,710	64,498.00	0.01
36	688663	新风光	3,279	62,989.59	0.01
37	688117	圣诺生物	1,672	60,141.84	0.01
38	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
39	688616	西力科技	3,918	53,990.04	0.01
40	300981	中红医疗	566	51,160.74	0.01
41	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
42	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
43	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00

44	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
45	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
46	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
47	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
48	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
49	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
50	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
51	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
52	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
53	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
54	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
55	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
56	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
57	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
58	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
59	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
60	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
61	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
62	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
63	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
64	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
65	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
66	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
67	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
68	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
69	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
70	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
71	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
72	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
73	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
74	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
75	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
76	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
77	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
78	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
79	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
80	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
81	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
82	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
83	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
84	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
85	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
86	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00

87	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
88	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
89	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
90	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
91	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
92	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
93	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
94	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
95	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
96	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
97	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
98	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
99	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	000001	平安银行	27,391,991.00	2.56
2	600036	招商银行	26,832,078.56	2.51
3	002142	宁波银行	20,048,588.15	1.88
4	601166	兴业银行	19,048,798.25	1.78
5	603259	药明康德	17,475,714.46	1.63
6	603501	韦尔股份	16,707,539.98	1.56
7	600900	长江电力	14,814,332.21	1.39
8	000733	振华科技	14,420,447.67	1.35
9	600104	上汽集团	13,130,701.00	1.23
10	601658	邮储银行	12,652,630.00	1.18
11	000002	万科 A	12,116,388.00	1.13
12	600809	山西汾酒	11,818,241.00	1.11
13	600050	中国联通	11,620,008.00	1.09
14	300014	亿纬锂能	11,325,046.00	1.06
15	600519	贵州茅台	10,702,373.00	1.00
16	601888	中国中免	10,656,364.00	1.00
17	300059	东方财富	10,543,792.37	0.99
18	600019	宝钢股份	10,529,614.00	0.98
19	300750	宁德时代	10,269,467.00	0.96
20	300124	汇川技术	9,654,730.52	0.90

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	600036	招商银行	34,049,002.00	3.18
2	601166	兴业银行	31,811,745.42	2.98
3	000001	平安银行	27,966,735.17	2.62
4	600519	贵州茅台	27,163,164.00	2.54
5	000002	万科A	24,380,899.17	2.28
6	600900	长江电力	24,033,560.00	2.25
7	601318	中国平安	22,407,842.00	2.10
8	000651	格力电器	19,189,265.41	1.79
9	600031	三一重工	18,842,606.00	1.76
10	002142	宁波银行	18,161,768.73	1.70
11	601888	中国中免	17,025,635.00	1.59
12	000725	京东方A	15,829,224.00	1.48
13	000333	美的集团	15,139,275.85	1.42
14	300274	阳光电源	14,973,972.00	1.40
15	300750	宁德时代	13,728,446.25	1.28
16	000733	振华科技	13,487,687.60	1.26
17	600048	保利地产	13,450,188.37	1.26
18	601658	邮储银行	13,335,192.00	1.25
19	600809	山西汾酒	13,248,578.00	1.24
20	601012	隆基股份	13,099,444.00	1.23

注：“卖出金额”是指卖出股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

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	808,109,886.75
卖出股票收入（成交）总额	1,057,657,161.83

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	24,979,473.40	2.93
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	24,979,473.40	2.93

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	019649	21 国债 01	249,620	24,979,473.40	2.93

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本期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。

1、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。

2、本基金投资的前十名证券中的招商银行，其发行主体为招商银行股份有限公司。

2021 年 5 月 17 日，中国银行保险监督管理委员会向招商银行股份有限公司做出了行政处罚决定（银保监罚决字〔2021〕16 号），依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一、四十五条、四十六条和相关审慎经营规则，就其理财资金池化运作、并表管理不到位等二十七项违法违规行为，决定罚款 7170 万元。

投资决策说明：招商银行股份有限公司（下称“公司”）的上述罚款合计金额在公司 2020 年全年净利润中占比小于 0.1%，对公司整体业务开展以及持续经营无重大不利影响，对公司资金周转和债务偿还影响小。

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	154,410.35
2	应收证券清算款	1,425,124.24
3	应收股利	-
4	应收利息	269,628.13
5	应收申购款	512,657.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,361,820.06

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	600905	三峡能源	5,147,016.21	0.60	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 (%)
融通巨潮 100 指数 A/B	35,456	16,282.40	103,182,831.58	17.87	474,125,963.04	82.13
融通巨潮 100 指数 C	1,047	3,010.71	0.00	0.00	3,152,215.67	100.00
合计	36,503	15,901.73	103,182,831.58	17.78	477,278,178.71	82.22

8.2 期末上市基金前十名持有人

融通巨潮 100 指数 A/B

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	宋適午	383,500.00	4.25
2	方燕秋	336,807.00	3.74
3	王翔	159,800.00	1.77
4	仇培红	142,000.00	1.57
5	何继忠	136,803.00	1.52
6	陈远中	127,800.00	1.42
7	钱中明	107,900.00	1.20
8	刘力新	103,000.00	1.14
9	李传宝	102,300.00	1.13
10	唐玲	100,000.00	1.11

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	融通巨潮 100 指数 A/B	91,453.46	0.01584
	融通巨潮 100 指数 C	846.85	0.02687
	合计	92,300.31	0.01590

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	融通巨潮 100 指数 A/B	0
	融通巨潮 100 指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	融通巨潮 100 指数 A/B	0
	融通巨潮 100 指数 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通巨潮 100 指数 A/B	融通巨潮 100 指数 C
基金合同生效日 (2005 年 5 月 12 日) 基金份额总额	513,527,198.43	-
本报告期期初基金份额总额	644,184,661.23	100,696,841.77
本报告期基金总申购份额	37,795,645.26	3,659,164.75
减：本报告期基金总赎回份额	104,671,511.87	101,203,790.85
本报告期期末基金份额总额	577,308,794.62	3,152,215.67

§ 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 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人无重大人事变更。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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)，该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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。

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	
光大证券	1	1,037,655,134.65	56.01%	966,364.93	56.54%	-
东吴证券	1	815,085,282.21	43.99%	742,789.97	43.46%	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
兴安证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

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

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

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

- (1) 券商服务评价；

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

3、交易单元变更情况

无。

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
光大证券	26,320,926.00	92.21%	-	-	-	-
东吴证券	1,257,422.39	4.40%	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
兴安证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	967,600.00	3.39%	-	-	-	-

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	融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 第二十五次分红公告	中国证券报、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	中国证券报、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	中国证券报、管理人网站	2021-01-25
4	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	中国证券报、管理人网站	2021-03-10
5	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	中国证券报、管理人网站	2021-03-16
6	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	中国证券报、管理人网站	2021-03-29
7	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	中国证券报、管理人网站	2021-03-30

8	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	中国证券报、 管理人网站	2021-04-12
9	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	中国证券报、 管理人网站	2021-04-14
10	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	中国证券报、 管理人网站	2021-04-20
11	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	中国证券报、 管理人网站	2021-04-20
12	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	中国证券报、 管理人网站	2021-04-27
13	融通旗下部分开放式基金新增上海中正达广基金销售有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务、转换业务及参与其费率优惠的公告	中国证券报、 管理人网站	2021-05-18
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	中国证券报、 管理人网站	2021-05-31
15	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告	中国证券报、 管理人网站	2021-06-08
16	关于融通基金管理有限公司旗下部分基金在中泰证券股份有限公司开通转换业务的公告	中国证券报、 管理人网站	2021-06-23
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	中国证券报、 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	中国证券报、 管理人网站	2021-06-30

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

2021 年 8 月 21 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于旗下深交所基金新增扩位简称的公告》，本基金场内扩位简称为“巨潮 100LOF”，场内扩位简称适用于交易、申购赎回及行情展示。

§ 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巨潮 100 指数证券投资基金设立的文件
- （二）《融通巨潮 100 指数证券投资基金基金合同》
- （三）《融通巨潮 100 指数证券投资基金托管协议》
- （四）《融通巨潮 100 指数证券投资基金招募说明书》及其更新
- （五）《融通巨潮 100 指数证券投资基金上市交易公告书》
- （六）融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- （七）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、深圳证券交易所。

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 8 月 27 日