

融通通利系列证券投资基金之  
融通深证 100 指数证券投资基金  
2023 年中期报告

2023 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：2023 年 8 月 25 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

融通通利系列证券投资基金由融通债券投资基金、融通深证 100 指数证券投资基金和融通蓝筹成长证券投资基金共同构成。本报告为融通通利系列证券投资基金之子基金融通深证 100 指数证券投资基金（以下简称“本基金”）2023 年中期报告。

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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《融通通利系列证券投资基金基金合同》规定，于 2023 年 8 月 18 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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2023 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 .....	6
3.3 其他指标 .....	8
<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 .....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	9
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 .....	10
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 .....	11
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 .....	11
<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内容的真实、准确和完整发表意见 .....	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表 .....	12
6.2 利润表 .....	13
6.3 净资产（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>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	39
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 .....	45
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 .....	45

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 本基金投资股指期货的投资政策 .....	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
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
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 .....	47
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>48</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>48</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	48
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 .....	48
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 .....	49
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 .....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
10.8 其他重大事件 .....	51
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>53</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	53
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>53</b>
12.1 备查文件目录 .....	53
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	融通深证 100 指数证券投资基金	
基金简称	融通深证 100 指数	
基金主代码	161604	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2003 年 9 月 30 日	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,363,805,559.53 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	融通深证 100 指数 A/B	融通深证 100 指数 C
下属分级基金的交易代码	161604	004876
下属分级基金的前端交易代码	161604	-
下属分级基金的后端交易代码	161654	-
报告期末下属分级基金的份额总额	3,351,792,336.95 份	12,013,222.58 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	运用指数化投资方式，通过控制股票投资组合与深证 100 指数的跟踪误差，力求实现对深证 100 指数的有效跟踪，谋求分享中国经济的持续、稳定增长和中国证券市场的发展，实现基金资产的长期增长，为投资者带来稳定回报。
投资策略	以非债券资产 90%以上的资金对深证 100 指数的成份股进行股票指数化投资。股票指数化投资部分不得低于基金资产的 50%，采用复制法跟踪深证 100 指数，对于因流动性等原因导致无法完全复制深证 100 指数的情况，将采用剩余组合替换等方法避免跟踪误差扩大。
业绩比较基准	深证 100 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%
风险收益特征	风险和预期收益率接近市场平均水平

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		融通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	涂卫东	郭明
	联系电话	(0755) 26948666	(010) 66105799
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-883-8088、(0755) 26948088	95588
传真		(0755) 26935005	(010) 66105798
注册地址		深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市南山区华侨城汉唐大厦 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		张威	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	上海证券报
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	基金管理人处、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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	融通深证 100 指数 A/B	融通深证 100 指数 C
本期已实现收益	5,404,382.21	-13,219.55
本期利润	-111,153,261.70	-382,866.52
加权平均基金份额本期利润	-0.0332	-0.0335
本期加权平均净值利润率	-2.29%	-2.37%
本期基金份额净值增长率	-2.28%	-2.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	1,286,225,613.29	4,215,004.47
期末可供分配基金份额利润	0.3837	0.3509
期末基金资产净值	4,638,017,950.24	16,228,227.05
期末基金份额净值	1.384	1.351
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	404.36%	19.47%

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)扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

融通深证 100 指数 A/B

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差	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
----	----------	------------	------------	---------------	-----	-----

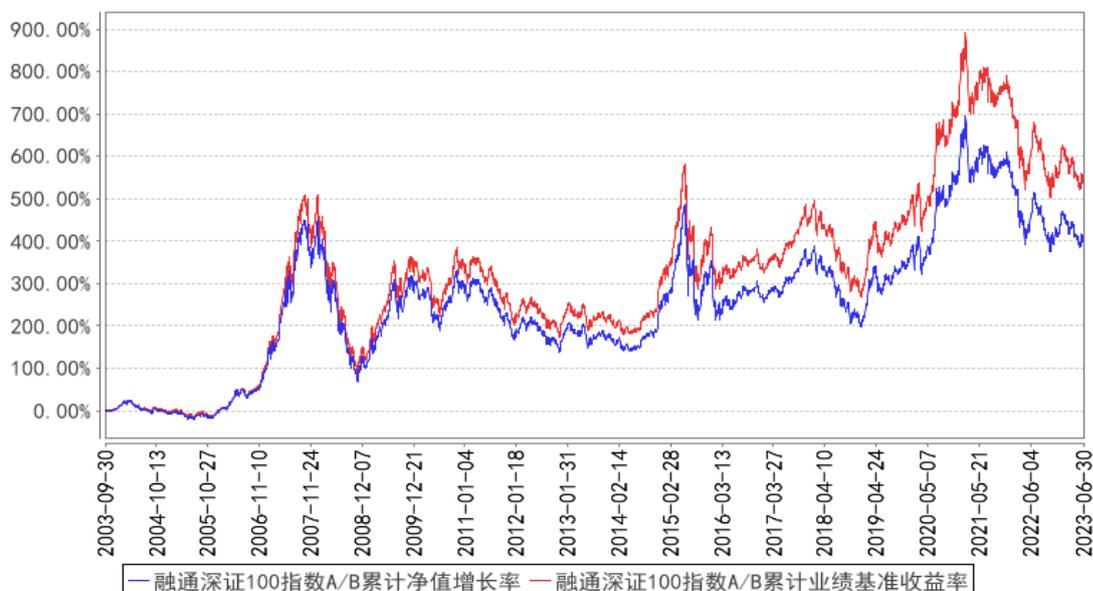
		②				
过去一个月	3.59%	1.05%	3.76%	1.06%	-0.17%	-0.01%
过去三个月	-6.42%	0.89%	-6.01%	0.90%	-0.41%	-0.01%
过去六个月	-2.28%	0.92%	-1.76%	0.92%	-0.52%	0.00%
过去一年	-17.20%	1.08%	-16.32%	1.08%	-0.88%	0.00%
过去三年	-6.00%	1.37%	-3.31%	1.36%	-2.69%	0.01%
自基金合同生效起至今	404.36%	1.67%	545.65%	1.63%	-141.29%	0.04%

融通深证 100 指数 C

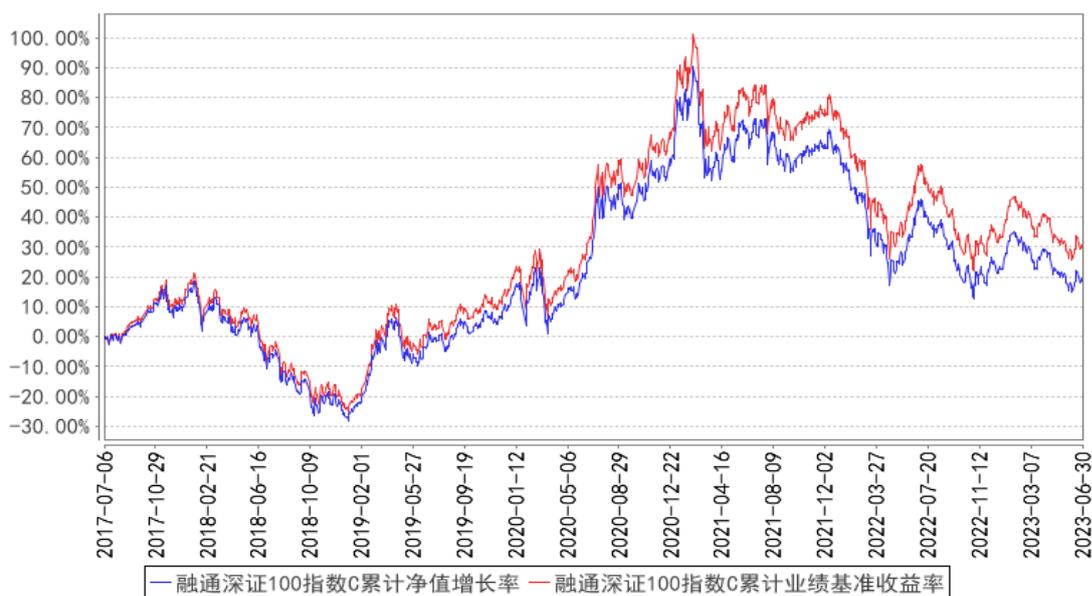
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.60%	1.06%	3.76%	1.06%	-0.16%	0.00%
过去三个月	-6.51%	0.89%	-6.01%	0.90%	-0.50%	-0.01%
过去六个月	-2.47%	0.92%	-1.76%	0.92%	-0.71%	0.00%
过去一年	-17.49%	1.08%	-16.32%	1.08%	-1.17%	0.00%
过去三年	-7.17%	1.37%	-3.31%	1.36%	-3.86%	0.01%
自基金合同生效起至今	19.47%	1.40%	30.84%	1.39%	-11.37%	0.01%

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

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



融通深证100指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金业绩比较基准项目分段计算，其中：2005年8月21日之前(含此日)采用“深证100指数×75%+银行间债券综合指数×25%”，2005年8月22日起使用新基准即“深证100指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%”。

2、本基金于2017年7月5日增加C类份额，C类份额的首次确认日为2017年7月6日，故本基金C类份额的统计区间为2017年7月6日至本报告期末。

### 3.3 其他指标

无。

## § 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：诚通证券股份有限公司60%、日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co., Ltd.）40%。本基金管理人拥有公募基金管理资格、特定客户（专户）资产管理资格、境内合格机构管理人资格（QDII）、保险资产受托管理资格、人民币合格境外机构投资者（RQFII）资格、合格境外机构投资者（QFII）资格，产品线完备，涵盖主动权益类基金、被动投资类基金、债券基金、货币基金、混合基金、QDII基金等等。

#### 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		
何天翔	本基金的基金经理、指数与量化投资部总经理	2014 年 10 月 25 日	-	15	何天翔先生，厦门大学经济学硕士，15 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2008 年 7 月至 2010 年 3 月就职于华泰联合证券有限责任公司任金融工程分析师。2010 年 3 月加入融通基金管理有限公司，历任金融工程研究员、专户投资经理、指数与量化投资部总监、融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）基金经理、融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通中证军工指数分级证券投资基金基金经理、融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理、融通中证精准医疗主题指数证券投资基金（LOF）基金经理、融通通瑞债券型证券投资基金基金经理，现任指数与量化投资部总经理、融通深证 100 指数证券投资基金基金经理、融通新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通中证人工智能主题指数证券投资基金（LOF）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、融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金（LOF）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向交

易的交易价差进行了分析，各投资组合的同向交易价差均处于合理范围之内。

报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

深证 100 指数由深圳交易所 100 只市值大，流动性好的 A 股股票编制而成，为深市核心指数之一，消费和科技的占比较高，前五大权重行业分别为电力设备、电子、医药、食品饮料、计算机。

本报告期内，本基金日均跟踪偏离为 0.03%，年化跟踪误差为 0.36%，符合基金合同约定。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通深证 100 指数 A/B 基金份额净值为 1.384 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.28%，同期业绩比较基准收益率为-1.76%；

截至本报告期末融通深证 100 指数 C 基金份额净值为 1.351 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.47%，同期业绩比较基准收益率为-1.76%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观数据看，今年上半年，国内生产总值同比增长 5.5%，明显快于去年全年 3%的经济增速，也快于一季度 4.5%的经济增速。在复杂严峻的外部环境下，我国经济增速明显快于世界主要发达经济体，彰显出我国经济发展的强大韧性。上半年，服务业增加值占国内生产总值的比重达到 56%，对经济增长的贡献率达到 66.1%，高于第二产业贡献率；装备制造业增加值占规模以上工业增加值的比重达到 32.3%，比上年同期提高 1.4 个百分点。消费投资结构改善，高技术产业投资同比增长 12.5%，明显快于全部投资增长。

上半年，外贸进出口稳中提质、符合预期。据海关统计，上半年我国货物贸易进出口总值 20.1 万亿元人民币，同比增长 2.1%。其中，出口 11.46 万亿元，同比增长 3.7%；进口 8.64 万亿元，同比下降 0.1%。

从货币政策看，稳健的货币政策将继续精准有力，应对超预期挑战和变化仍有充足的政策空间。后续人民银行将根据经济和物价形势的需要，按照党中央、国务院的决策部署，加大宏观调

控力度，精准有力实施稳健的货币政策，综合运用存款准备金率、中期借贷便利、公开市场操作等多种货币政策工具，保持银行体系流动性和合理充裕，保持货币信贷合理增长，推动企业融资和居民信贷成本稳中有降。

从因子角度看，报告期内，动量、价值、市值等因子相对表现较好，而成长因子表现一般。

再看深证 100 指数，近年来深证 100 指数的估值逐步提升，估值中枢也同时提升，目前 20 倍左右的 TTM 市盈率，处于历史 36% 左右的分位点，处于低估水平。当前深证 100 指数 2023 年一致预期净利润增长率为 29%，市场预期成长性较好。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于 2023 年 1 月 16 日实施 2022 年第 1 次利润分配，以 2022 年 12 月 31 日的可分配收益为基准，融通深证 100 指数 A/B 每 10 份基金份额派发红利 0.05 元，融通深证 100 指数 C 每 10 份基金份额派发红利 0.05 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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，本基金的管理人——融通基金管理有限公司在本基金的投资运作、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，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

### 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本基金 2023 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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：融通通利系列证券投资基金之融通深证 100 指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	279,865,656.41	261,340,078.78
结算备付金		167,922.32	91,956.20
存出保证金		22,870.29	58,347.94
交易性金融资产	6.4.7.2	4,397,688,576.66	4,485,093,633.84
其中：股票投资		4,397,688,576.66	4,485,093,633.84
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-

其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		961,388.06	1,101,164.15
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		4,678,706,413.74	4,747,685,180.91
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022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		-	-
应付清算款		9,951,793.43	14.47
应付赎回款		9,432,788.78	2,312,720.03
应付管理人报酬		3,800,715.91	4,050,480.89
应付托管费		760,143.18	810,096.15
应付销售服务费		5,210.35	5,397.64
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	509,584.80	960,910.87
负债合计		24,460,236.45	8,139,620.05
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	3,363,805,559.53	3,335,100,376.50
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	1,290,440,617.76	1,404,445,184.36
净资产合计		4,654,246,177.29	4,739,545,560.86
负债和净资产总计		4,678,706,413.74	4,747,685,180.91

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 3,363,805,559.53 份，其中融通深证 100 指数 A/B 类基金份额 3,351,792,336.95 份，基金份额净值 1.384 元；融通深证 100 指数 C 类基金份额 12,013,222.58 份，基金份额净值 1.351 元。

## 6.2 利润表

会计主体：融通通利系列证券投资基金之融通深证 100 指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 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
----	-----	----	---------

		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-82,391,267.45	-624,840,503.56
1. 利息收入		485,373.00	366,623.17
其中：存款利息收入	6.4.7.13	485,373.00	366,623.17
债券利息收入		-	-
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（损失以“-”填列）		33,924,410.11	41,867,063.19
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-11,589,548.54	1,965,579.22
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	1,290,009.69
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	45,513,958.65	38,611,474.28
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-116,927,290.88	-667,305,006.57
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	126,240.32	230,816.65
<b>减：二、营业总支出</b>		29,144,860.77	30,699,766.69
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	24,149,639.15	25,438,142.87
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,829,927.86	5,087,628.54
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	32,117.43	30,863.39
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	0.40
8. 其他费用	6.4.7.23	133,176.33	143,131.49
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-111,536,128.22	-655,540,270.25
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-111,536,128.22	-655,540,270.25
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-	-

		111,536,128.22	655,540,270.25
--	--	----------------	----------------

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：融通通利系列证券投资基金之融通深证 100 指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	3,335,100,376.50	-	1,404,445,184.36	4,739,545,560.86
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	3,335,100,376.50	-	1,404,445,184.36	4,739,545,560.86
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	28,705,183.03	-	-114,004,566.60	-85,299,383.57
(一)、综合收益总额	-	-	-111,536,128.22	-111,536,128.22
(二)、本期基金份额 交易产生的基金净值 变动数(净值减少以 “-”号填列)	28,705,183.03	-	14,229,792.65	42,934,975.68
其中：1. 基金申购款	218,568,057.99	-	99,970,697.73	318,538,755.72
2. 基金赎回款	-189,862,874.96	-	-85,740,905.08	-275,603,780.04
(三)、本期向基金份 额持有人分配利润产 生的基金净值变动 (净值减少以“-”号 填列)	-	-	-16,698,231.03	-16,698,231.03
(四)、其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	3,363,805,559.53	-	1,290,440,617.76	4,654,246,177.29
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	3,141,691,623.21	-	2,806,182,694.24	5,947,874,317.45
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	3,141,691,623.21	-	2,806,182,694.24	5,947,874,317.45

三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	122,651,187.73	-	-597,826,935.21	-475,175,747.48
(一)、综合收益总额	-	-	-655,540,270.25	-655,540,270.25
(二)、本期基金份额 交易产生的基金净值 变动数(净值减少以 “-”号填列)	122,651,187.73	-	73,470,410.73	196,121,598.46
其中: 1. 基金申购款	323,456,095.67	-	194,937,283.47	518,393,379.14
2. 基金赎回款	-200,804,907.94	-	-121,466,872.74	-322,271,780.68
(三)、本期向基金份 额持有人分配利润产 生的基金净值变动 (净值减少以“-”号 填列)	-	-	-15,757,075.69	-15,757,075.69
(四)、其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	3,264,342,810.94	-	2,208,355,759.03	5,472,698,569.97

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

高翔

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 100 指数证券投资基金(以下简称“本基金”)是融通通利系列证券投资基金(以下简称“本系列基金”)之子基金,本系列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[2003]第 94 号《关于同意融通通利系列证券投资基金设立的批复》核准,由融通基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定(后由《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法规替代)和《融通通利系列证券投资基金基金契约》(后更名为《融通通利系列证券投资基金基金合同》)发起,并于 2003 年 9 月 30 日募集成立。本基金为契约型开放式,存续期限不定,本基金首次设立,包括认购资金利息共募集人民币 477,689,377.16 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第 138 号验资报告予以验证,其中认购资金为人民币 477,610,977.87 元,认购资金产生利息为人民币 78,399.29 元。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《关于融通深证 100 指数证券投资基金增设 H 类基金份额类别并修改基金合同的公告》以及更新的《融通通利系列证券投资基金更新招募说明书》的有关规定，自 2016 年 7 月 14 日起，本基金根据销售对象的不同，将基金份额分为不同的类别。在中国内地销售的、为中国内地投资者设立的份额，称为 A 类基金份额；在中国香港地区销售的、为中国香港投资者设立的份额，称为 H 类基金份额。本基金 A 类基金份额、H 类基金份额单独设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。除非基金管理人在未来条件成熟后另行公告开通相关业务，本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《关于融通深证 100 指数证券投资基金增设 C 类基金份额并修订基金合同部分条款的公告》以及更新的《融通通利系列证券投资基金更新招募说明书》的有关规定，自 2017 年 7 月 5 日起，本基金根据销售服务费或申购费收取方式的不同以及销售对象的不同将基金份额分为不同的类别。在中国内地销售的、为中国内地投资者设立的，在投资者申购时收取前端申购费用，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的份额，称为 A 类基金份额；在中国内地销售的、为中国内地投资者设立的，在投资者赎回时收取后端申购费用，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的份额，称为 B 类基金份额；在中国内地销售的、为中国内地投资者设立的，不收取前/后端申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的份额，称为 C 类基金份额；在中国香港地区销售的、为中国香港投资者设立的份额，称为 H 类基金份额。本基金 A/B 类基金份额、C 类基金份额、H 类基金份额单独设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。除非基金管理人在未来条件成熟后另行公告开通相关业务，本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。截至 2023 年 6 月 30 日，本基金尚未正式开通 H 类基金份额申赎业务。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通通利系列证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为深证 100 指数成份股和债券，以基金非债券资产 90%以上的资金对深证 100 指数的成份股进行股票指数化投资，其中股票指数化投资部分不得低于基金资产的 50%，相对于深证 100 指数的日跟踪误差不超过 0.5%。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。此外本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的 80%；并保持不低于基金资产净值 5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券。本基金业绩比较基准为：深证 100 指数收益率 X 95% + 银行同业存款利率 X 5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（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》、《融通通利系列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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	279,865,656.41
等于：本金	279,841,665.53
加：应计利息	23,990.88
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	279,865,656.41

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票	3,458,614,529.84	-	4,397,688,576.66	939,074,046.82
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,458,614,529.84	-	4,397,688,576.66	939,074,046.82

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	17,825.95
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	113,286.52
其中：交易所市场	113,286.52
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	128,472.33
合计	509,584.80

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

融通深证 100 指数 A/B

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,323,648,208.36	3,323,648,208.36
本期申购	215,537,040.96	215,537,040.96
本期赎回（以“-”号填列）	-187,392,912.37	-187,392,912.37
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	3,351,792,336.95	3,351,792,336.95

融通深证 100 指数 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,452,168.14	11,452,168.14
本期申购	3,031,017.03	3,031,017.03
本期赎回（以“-”号填列）	-2,469,962.59	-2,469,962.59
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	12,013,222.58	12,013,222.58

注：申购含红利再投及转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

##### 融通深证 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	1,986,476,158.32	-586,500,810.97	1,399,975,347.35
本期利润	5,404,382.21	-116,557,643.91	-111,153,261.70
本期基金份额交易产生的变动数	16,731,929.27	-2,686,041.57	14,045,887.70
其中：基金申购款	127,773,306.15	-29,057,965.40	98,715,340.75
基金赎回款	-111,041,376.88	26,371,923.83	-84,669,453.05
本期已分配利润	-16,642,360.06	-	-16,642,360.06
本期末	1,991,970,109.74	-705,744,496.45	1,286,225,613.29

##### 融通深证 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	6,027,810.38	-1,557,973.37	4,469,837.01
本期利润	-13,219.55	-369,646.97	-382,866.52
本期基金份额交易产生的变动数	289,547.83	-105,642.88	183,904.95
其中：基金申购款	1,575,556.60	-320,199.62	1,255,356.98
基金赎回款	-1,286,008.77	214,556.74	-1,071,452.03
本期已分配利润	-55,870.97	-	-55,870.97
本期末	6,248,267.69	-2,033,263.22	4,215,004.47

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	484,087.05
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	989.01
其他	296.94
合计	485,373.00

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-11,589,548.54
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	-11,589,548.54

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	64,344,175.75
减：卖出股票成本总额	75,708,314.41
减：交易费用	225,409.88
买卖股票差价收入	-11,589,548.54

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

## 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

## 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	45,513,958.65
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	45,513,958.65

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-116,927,290.88
股票投资	-116,927,290.88

债券投资	-
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	-116,927,290.88

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	76,304.07
基金转换费收入	49,936.25
合计	126,240.32

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. 基金转换收取转换费和补差费，其中本基金与本基金管理人旗下除融通通利系列证券投资基金外的其他基金的转换，不低于转换费的 25% 归入基金资产。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	64,464.96
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	204.00
账户维护费	9,000.00
合计	133,176.33

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	24,149,639.15	25,438,142.87
其中：支付销售机构的客户维护费	11,449,939.76	12,103,406.01

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% / \text{当年天数}。$$

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,829,927.86	5,087,628.54

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：

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

## 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通深证 100 指数 A/B	融通深证 100 指数 C	合计
融通基金	-	5,387.78	5,387.78
中国工商银行	-	1.33	1.33
合计	-	5,389.11	5,389.11
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通深证 100 指数 A/B	融通深证 100 指数 C	合计
融通基金	-	3,519.81	3,519.81
合计	-	3,519.81	3,519.81

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给融通基金，再由融通基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 X 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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

## 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

## 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

## 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

## 6.4.10.5.2 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。

## 6.4.10.6 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	279,865,656.41	484,087.05	269,296,728.02	362,176.14
--------	----------------	------------	----------------	------------

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。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 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

融通深证 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
1	2023 年 1 月 16 日	2023 年 1 月 16 日	0.0500	5,934,334.60	10,708,025.46	16,642,360.06	-
合计	-	-	0.0500	5,934,334.60	10,708,025.46	16,642,360.06	-
融通深证 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
1	2023 年 1 月 16 日	2023 年 1 月 16 日	0.0500	43,268.71	12,602.26	55,870.97	-
合计	-	-	0.0500	43,268.71	12,602.26	55,870.97	-

#### 6.4.12 期末（2023 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	受限期	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
001282	三联锻造	2023 年 5 月 15 日	1-6 个月（含）	首发流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	1-6 个月（含）	首发流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	1-6 个月（含）	首发流通受限	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	1-6 个月（含）	首发流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	1-6 个月（含）	首发流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-

001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
001380	华纬科技	2023 年 5 月 9 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
300804	广康生化	2023 年 6 月 15 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301141	中科磁业	2023 年 3 月 27 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023 年 6 月 16 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1 个月内 (含)	首发流通受限	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301203	国泰环保	2023 年 3 月 28 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301210	金杨股份	2023 年 6 月 21 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
301225	恒勃股份	2023 年 6 月 8 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301232	飞沃科技	2023 年 6 月 8 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301260	格力博	2023 年 1 月 20 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	30.85	23.63	3,121	96,282.85	73,749.23	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1 个月内 (含)	首发流通受限	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301262	海看股份	2023 年 6 月 13 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301281	科源制药	2023 年 3 月 28 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	44.18	25.10	241	10,647.38	6,049.10	-
301281	科源制药	2023 年 5 月 26 日	1-6 个月 (含)	送股流通受限	-	25.10	97	-	2,434.70	-
301291	明阳电气	2023 年 6 月 21 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	38.13	31.03	1,206	45,984.78	37,422.18	-
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	1 个月内 (含)	首发流通受限	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-

		月 29 日	(含)	通受限							
301293	三博脑科	2023 年 4 月 25 日	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-	
301295	美硕科技	2023 年 6 月 19 日	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-	
301301	川宁生物	2022 年 12 月 20 日	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-	
301303	真兰仪表	2023 年 2 月 13 日	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	-	
301305	朗坤环境	2023 年 5 月 15 日	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-	
301307	美利信	2023 年 4 月 14 日	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-	
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-	
301317	鑫磊股份	2023 年 1 月 12 日	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-	
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-	
301322	绿通科技	2023 年 2 月 27 日	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	131.1 1	53.24	261	34,219.71	13,895.64	-	
301322	绿通科技	2023 年 5 月 25 日	1-6 个月 (含)	送股流 通受限	-	53.24	131	-	6,974.44	-	
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-	
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-	
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-	
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-	
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	73.45	46.64	186	13,661.70	8,675.04	-	
301355	南王科技	2023 年 6 月 2 日	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-	
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-	
301360	荣旗科技	2023 年 4 月 17 日	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-	
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-	
301376	致欧科技	2023 年 6 月 14 日	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-	

301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301386	未来电器	2023 年 3 月 21 日	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301387	光大同创	2023 年 4 月 10 日	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-
301395	仁信新材	2023 年 6 月 21 日	1 个月内 (含)	首发流 通受限	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
301395	仁信新材	2023 年 6 月 21 日	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-
301397	溯联股份	2023 年 6 月 15 日	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301399	英特科技	2023 年 5 月 16 日	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301408	华人健康	2023 年 2 月 22 日	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301419	阿莱德	2023 年 2 月 2 日	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月内 (含)	首发流 通受限	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12	-
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	1 个月内 (含)	首发流 通受限	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-

注：1、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。

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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。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。

于 2023 年 6 月 30 日，本基金无债券投资(2022 年 12 月 31 日：同)。

#### 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 2023 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同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(净资产)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 2023 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。于 2023 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 2023 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	279,865,656.41	-	-	-	279,865,656.41
结算备付金	167,922.32	-	-	-	167,922.32
存出保证金	22,870.29	-	-	-	22,870.29
交易性金融资产	-	-	-	4,397,688,576.66	4,397,688,576.66
应收申购款	-	-	-	961,388.06	961,388.06

资产总计	280,056,449.02	-	-	-4,398,649,964.72	4,678,706,413.74
负债					
应付赎回款	-	-	-	9,432,788.78	9,432,788.78
应付管理人报酬	-	-	-	3,800,715.91	3,800,715.91
应付托管费	-	-	-	760,143.18	760,143.18
应付清算款	-	-	-	9,951,793.43	9,951,793.43
应付销售服务费	-	-	-	5,210.35	5,210.35
其他负债	-	-	-	509,584.80	509,584.80
负债总计	-	-	-	24,460,236.45	24,460,236.45
利率敏感度缺口	280,056,449.02	-	-	-4,374,189,728.27	4,654,246,177.29
上年度末 2022 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	261,340,078.78	-	-	-	261,340,078.78
结算备付金	91,956.20	-	-	-	91,956.20
存出保证金	58,347.94	-	-	-	58,347.94
交易性金融资产	-	-	-	-4,485,093,633.84	4,485,093,633.84
应收申购款	-	-	-	1,101,164.15	1,101,164.15
资产总计	261,490,382.92	-	-	-4,486,194,797.99	4,747,685,180.91
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,312,720.03	2,312,720.03
应付管理人报酬	-	-	-	4,050,480.89	4,050,480.89
应付托管费	-	-	-	810,096.15	810,096.15
应付清算款	-	-	-	14.47	14.47
应付销售服务费	-	-	-	5,397.64	5,397.64
其他负债	-	-	-	960,910.87	960,910.87
负债总计	-	-	-	8,139,620.05	8,139,620.05
利率敏感度缺口	261,490,382.92	-	-	-4,478,055,177.94	4,739,545,560.86

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 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2022 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2022 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 100 指数的跟踪误差,力求实现对深证 100 指数的有效跟踪。风险管理部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。本基金投资组合中股票、债券的比例不低于本基金资产总值的 80%;并保持不低于基金资产净值 5%的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)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 2023年6月30日		上年度末 2022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	4,397,688,576.66	94.49	4,485,093,633.84	94.63
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	4,397,688,576.66	94.49	4,485,093,633.84	94.63

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除深证 100 指数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(2023年6月30日)	上年度末(2022年12月31日)
	深证 100 指数上升 5%	220,058,100.45	223,609,233.71

深证 100 指数下降 5%	-220,058,100.45	-223,609,233.71
----------------	-----------------	-----------------

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	4,396,088,367.81	4,484,181,120.63
第二层次	788,929.18	-
第三层次	811,279.67	912,513.21
合计	4,397,688,576.66	4,485,093,633.84

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2022 年 12 月 31 日：同）。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

公允价值相差很小。

#### 6.4.15 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	4,397,688,576.66	93.99
	其中：股票	4,397,688,576.66	93.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	280,033,578.73	5.99
8	其他各项资产	984,258.35	0.02
9	合计	4,678,706,413.74	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	139,521,589.30	3.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,369,218,500.52	72.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,057,329.00	0.32
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	25,133,001.74	0.54
G	交通运输、仓储和邮政业	69,193,941.66	1.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	178,329,344.41	3.83
J	金融业	355,337,206.94	7.63
K	房地产业	94,988,723.86	2.04
L	租赁和商务服务业	50,060,875.23	1.08
M	科学研究和技术服务业	35,948,139.90	0.77
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	49,483,664.65	1.06

R	文化、体育和娱乐业	13,816,050.60	0.30
S	综合	-	-
	合计	4,396,088,367.81	94.45

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,408,273.90	0.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	53,486.97	0.00
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	56,651.08	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	22,566.57	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,600,208.85	0.03

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 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	1,687,906	386,176,013.74	8.30
2	000858	五粮液	1,380,296	225,775,016.72	4.85
3	000333	美的集团	3,458,920	203,799,566.40	4.38
4	002594	比亚迪	583,145	150,608,859.15	3.24
5	300059	东方财富	8,451,273	120,008,076.60	2.58
6	000568	泸州老窖	549,690	115,198,533.30	2.48
7	000651	格力电器	3,054,222	111,509,645.22	2.40
8	002475	立讯精密	3,118,722	101,202,528.90	2.17
9	300760	迈瑞医疗	328,512	98,487,897.60	2.12
10	000063	中兴通讯	2,072,840	94,397,133.60	2.03

11	002415	海康威视	2,673,840	88,530,842.40	1.90
12	002230	科大讯飞	1,242,131	84,415,222.76	1.81
13	000725	京东方 A	20,286,203	82,970,570.27	1.78
14	300124	汇川技术	1,272,645	81,716,535.45	1.76
15	300274	阳光电源	682,400	79,588,312.00	1.71
16	002714	牧原股份	1,724,945	72,706,431.75	1.56
17	002352	顺丰控股	1,534,574	69,193,941.66	1.49
18	300498	温氏股份	3,641,153	66,815,157.55	1.44
19	002129	TCL 中环	2,008,000	66,665,600.00	1.43
20	000001	平安银行	5,668,478	63,657,007.94	1.37
21	002142	宁波银行	2,445,092	61,860,827.60	1.33
22	000002	万 科 A	4,250,605	59,593,482.10	1.28
23	002304	洋河股份	422,150	55,449,402.50	1.19
24	002371	北方华创	174,500	55,429,925.00	1.19
25	300014	亿纬锂能	888,227	53,737,733.50	1.15
26	002027	分众传媒	7,351,083	50,060,875.23	1.08
27	002466	天齐锂业	710,800	49,692,028.00	1.07
28	300015	爱尔眼科	2,667,583	49,483,664.65	1.06
29	002460	赣锋锂业	771,590	47,036,126.40	1.01
30	000338	潍柴动力	3,463,736	43,158,150.56	0.93
31	002049	紫光国微	457,279	42,641,266.75	0.92
32	000792	盐湖股份	2,201,481	42,202,390.77	0.91
33	000625	长安汽车	3,060,339	39,570,183.27	0.85
34	002050	三花智控	1,287,714	38,966,225.64	0.84
35	000100	TCL 科技	9,511,404	37,474,931.76	0.81
36	000938	紫光股份	1,157,359	36,861,884.15	0.79
37	002459	晶澳科技	883,792	36,854,126.40	0.79
38	002271	东方雨虹	1,327,003	36,174,101.78	0.78
39	002555	三七互娱	1,030,000	35,926,400.00	0.77
40	002709	天赐材料	839,614	34,583,700.66	0.74
41	300122	智飞生物	757,719	33,491,179.80	0.72
42	002179	中航光电	731,406	33,169,262.10	0.71
43	002812	恩捷股份	338,831	32,646,366.85	0.70
44	000661	长春高新	234,156	31,915,462.80	0.69
45	002410	广联达	939,085	30,510,871.65	0.66
46	000166	申万宏源	6,505,069	30,053,418.78	0.65
47	002241	歌尔股份	1,657,943	29,428,488.25	0.63
48	300142	沃森生物	1,103,256	29,181,121.20	0.63
49	000776	广发证券	1,937,466	28,500,124.86	0.61
50	300896	爱美客	63,626	28,310,388.70	0.61
51	300316	晶盛机电	385,800	27,353,220.00	0.59
52	300450	先导智能	736,502	26,639,277.34	0.57
53	002493	荣盛石化	2,235,750	26,024,130.00	0.56

54	300408	三环集团	876,680	25,730,558.00	0.55
55	000768	中航西飞	955,517	25,560,079.75	0.55
56	002920	德赛西威	163,475	25,471,039.75	0.55
57	000538	云南白药	482,726	25,333,460.48	0.54
58	002236	大华股份	1,278,662	25,253,574.50	0.54
59	000963	华东医药	579,502	25,133,001.74	0.54
60	300347	泰格医药	380,685	24,569,409.90	0.53
61	002311	海大集团	520,200	24,366,168.00	0.52
62	001979	招商蛇口	1,841,552	23,995,422.56	0.52
63	000596	古井贡酒	93,731	23,187,174.78	0.50
64	300033	同花顺	128,600	22,541,008.00	0.48
65	300782	卓胜微	232,362	22,453,140.06	0.48
66	002202	金风科技	1,926,494	20,459,366.28	0.44
67	000157	中联重科	2,985,488	20,152,044.00	0.43
68	000425	徐工机械	2,841,900	19,239,663.00	0.41
69	300661	圣邦股份	223,606	18,364,760.78	0.39
70	002001	新和成	1,159,890	17,862,306.00	0.38
71	002821	凯莱英	150,080	17,688,428.80	0.38
72	000876	新希望	1,477,124	17,252,808.32	0.37
73	002601	龙佰集团	1,019,503	16,821,799.50	0.36
74	002736	国信证券	1,912,552	16,696,578.96	0.36
75	000895	双汇发展	678,903	16,626,334.47	0.36
76	002841	视源股份	248,157	16,586,813.88	0.36
77	300454	深信服	145,000	16,421,250.00	0.35
78	300751	迈为股份	95,360	16,152,076.80	0.35
79	000786	北新建材	655,800	16,073,658.00	0.35
80	002180	纳思达	445,500	15,258,375.00	0.33
81	300433	蓝思科技	1,235,018	14,523,811.68	0.31
82	003816	中国广核	4,573,900	14,224,829.00	0.31
83	300413	芒果超媒	403,860	13,816,050.60	0.30
84	300999	金龙鱼	326,614	13,061,293.86	0.28
85	000301	东方盛虹	1,040,881	12,303,213.42	0.26
86	000617	中油资本	1,662,540	12,020,164.20	0.26
87	000069	华侨城 A	2,590,868	11,399,819.20	0.24
88	300759	康龙化成	297,250	11,378,730.00	0.24
89	301269	华大九天	90,000	11,055,600.00	0.24
90	300628	亿联网络	314,160	11,017,591.20	0.24
91	002916	深南电路	129,880	9,789,055.60	0.21
92	002938	鹏鼎控股	382,900	9,300,641.00	0.20
93	000708	中信特钢	556,098	8,808,592.32	0.19
94	002603	以岭药业	300,000	7,707,000.00	0.17
95	300919	中伟股份	114,400	6,892,600.00	0.15
96	300763	锦浪科技	60,000	6,246,000.00	0.13

97	300957	贝泰妮	69,100	6,141,608.00	0.13
98	300979	华利集团	59,814	2,915,334.36	0.06
99	001289	龙源电力	37,000	832,500.00	0.02

### 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	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.01
2	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.00
3	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.00
4	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.00
5	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
6	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
7	301260	格力博	3,121	73,749.23	0.00
8	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
9	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
10	301291	明阳电气	1,206	37,422.18	0.00
11	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
12	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
13	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
14	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
15	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
16	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
17	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
18	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
19	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
20	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
21	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
22	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
23	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
24	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
25	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
26	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
27	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
28	301210	金杨股份	281	13,816.77	0.00
29	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
30	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
31	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
32	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
33	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
34	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
35	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
36	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
37	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00

38	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
39	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
40	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
41	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
42	301345	涛涛车业	186	8,675.04	0.00
43	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
44	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
45	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
46	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
47	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
48	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
49	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
50	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
51	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
52	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
53	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
54	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
55	001367	海森药业	55	2,171.40	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	300750	宁德时代	32,701,446.00	0.69
2	301269	华大九天	11,347,025.00	0.24
3	002920	德赛西威	10,953,241.00	0.23
4	002603	以岭药业	8,106,151.00	0.17
5	300751	迈为股份	8,012,148.00	0.17
6	002555	三七互娱	7,209,769.00	0.15
7	300760	迈瑞医疗	5,949,375.00	0.13
8	000938	紫光股份	4,559,532.00	0.10
9	000617	中油资本	4,329,718.00	0.09
10	300498	温氏股份	3,549,365.00	0.07
11	301260	格力博	962,581.70	0.02
12	301358	湖南裕能	480,772.02	0.01
13	301291	明阳电气	459,619.02	0.01
14	001286	陕西能源	361,603.20	0.01
15	301322	绿通科技	341,410.44	0.01
16	301303	真兰仪表	283,383.20	0.01
17	301325	曼恩斯特	279,244.80	0.01
18	301486	致尚科技	277,921.20	0.01
19	301307	美利信	222,014.10	0.00
20	301262	海看股份	209,031.74	0.00

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	000661	长春高新	11,849,121.00	0.25
2	300601	康泰生物	9,022,088.94	0.19
3	002414	高德红外	8,373,381.74	0.18
4	300122	智飞生物	6,405,960.00	0.14
5	300059	东方财富	4,914,295.00	0.10
6	000651	格力电器	4,903,756.00	0.10
7	300274	阳光电源	4,860,674.00	0.10
8	300015	爱尔眼科	4,116,697.60	0.09
9	301260	格力博	997,673.18	0.02
10	301358	湖南裕能	951,470.81	0.02
11	001286	陕西能源	451,944.00	0.01
12	001287	中电港	376,091.10	0.01
13	301291	明阳电气	348,299.80	0.01
14	301303	真兰仪表	331,537.44	0.01
15	301322	绿通科技	322,865.40	0.01
16	301325	曼恩斯特	311,204.88	0.01
17	301262	海看股份	243,847.50	0.01
18	301439	泓淋电力	213,220.60	0.00
19	301408	华人健康	206,320.50	0.00
20	301307	美利信	178,225.64	0.00

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	105,230,548.11
卖出股票收入（成交）总额	64,344,175.75

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

无。

#### 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

无。

#### 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 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 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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的发行主体本期没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

无。

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	22,870.29
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	961,388.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	984,258.35

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	301486	致尚科技	277,921.20	0.01	首发流通受限
2	301395	仁信新材	138,629.28	0.00	首发流通受限
3	301292	海科新源	116,421.76	0.00	首发流通受限
4	301488	豪恩汽电	104,144.04	0.00	首发流通受限
5	301358	湖南裕能	86,766.47	0.00	首发流通受限

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 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 100 指数 A/B	271,445	12,347.96	30,453,081.43	0.91	3,321,339,255.52	99.09
融通深证 100 指数 C	2,489	4,826.53	0.00	0.00	12,013,222.58	100.00
合计	273,934	12,279.62	30,453,081.43	0.91	3,333,352,478.10	99.09

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	融通深证 100 指数 A/B	941,596.77	0.02809
	融通深证 100 指数 C	1,607.80	0.01338
	合计	943,204.57	0.02804

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

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通深证 100 指数 A/B	融通深证 100 指数 C
基金合同生效日（2003 年 9 月 30 日）基金份额总额	477,689,377.16	-
本报告期期初基金份额总额	3,323,648,208.36	11,452,168.14
本报告期基金总申购份额	215,537,040.96	3,031,017.03
减：本报告期基金总赎回份额	187,392,912.37	2,469,962.59
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,351,792,336.95	12,013,222.58

### § 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

1、2023 年 1 月 20 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，本公司首席信息官由 Allen Yan（颜锡廉）变更为高翔，上述变更事项经本公司董事会审议通过。

2、2023 年 3 月 14 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，新任杜国彦为公司副总经理，上述变更事项经本公司董事会审议通过。

3、2023 年 4 月，经本公司股东会表决通过，由江涛先生担任公司董事，吕秋梅女士不再担任公司董事。

4、2023 年 4 月 28 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，新任商小虎为公司副总经理，上述变更事项经本公司董事会审议通过。

5、2023 年 4 月 28 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员

变更的公告》，新任王智鲲为公司财务负责人，上述变更事项经本公司董事会审议通过。

#### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

#### 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

##### 10.6.1 管理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及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

##### 10.6.2 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(%)	
浙商证券	1	62,328,822.91	38.70	57,424.03	38.70	-
中泰证券	3	59,738,949.27	37.09	55,037.82	37.09	-
华西证券	1	38,994,173.57	24.21	35,925.06	24.21	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-

国泰君安	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	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	-	-	-	-	-
野村东方证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中信证券（山东）	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，新增国泰君安证券交易单元 1 个。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
野村东方证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券（山东）	-	-	-	-	-	-

### 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	融通基金关于网上直销平台费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 7 日
2	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在部分销售机构开通定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 10 日
3	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在部分销售机构开通转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 10 日
4	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在上海天天、北京中植开	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 10 日

	通转换业务的公告		
5	融通通利系列证券投资基金之融通深证 100 指数证券投资基金第二十六次分红公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 11 日
6	融通管理有限公司关于提醒投资者注意防范不法分子冒用“融通基金”名义进行诈骗活动的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 19 日
7	关于融通旗下部分基金增加招商银行股份有限公司招赢通为销售平台并开展费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 20 日
8	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 20 日
9	关于融通基金管理有限公司旗下部分基金增加招商银行股份有限公司招赢通为销售平台并开通转换业务及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 6 日
10	关于旗下部分开放式基金新增海通证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参与其前端申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 20 日
11	融通基金管理有限公司关于提醒投资者注意防范不法分子诈骗活动的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 27 日
12	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增博时财富基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 6 日
13	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 14 日
14	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金在腾安基金销售（深圳）有限公司开通转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 17 日
15	融通基金管理有限公司关于公司董事变更情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 14 日
16	关于旗下部分开放式基金新增华宝证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 18 日
17	关于旗下部分开放式基金新增诚通证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 19 日
18	关于旗下部分开放式基金新增中国中金财富证券有限公司为销售机构并开	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 21 日

	通定期定额投资、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告		
19	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 28 日
20	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 28 日
21	关于旗下部分开放式基金新增中国工商银行股份有限公司为销售机构并开通转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 18 日
22	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加珠海盈米基金销售有限公司转换费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 22 日

### § 11 影响投资者决策的其他重要信息

#### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

#### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

### § 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通利系列证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通通利系列证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通通利系列证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通通利系列证券投资基金招募说明书》及其更新
- (五) 融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- (六) 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

#### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

#### 12.3 查阅方式

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

融通基金管理有限公司

2023 年 8 月 25 日