

# 融通深证成份指数证券投资基金 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

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据融通深证成份指数证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同规定，于 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	7
3.3 其他指标	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
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	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>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 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	14
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	55
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 .....	55
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 .....	55
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 .....	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	55
7.12 投资组合报告附注 .....	56
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>56</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	57
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 .....	57
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>57</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>57</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	57
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 .....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	58
10.4 基金投资策略的改变 .....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	58
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 .....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	58
10.8 其他重大事件 .....	61
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>62</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 .....	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	62
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>62</b>
12.1 备查文件目录 .....	62
12.2 存放地点 .....	62
12.3 查阅方式 .....	62

## § 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金名称	融通深证成份指数证券投资基金	
基金简称	融通深证成份指数	
基金主代码	161612	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010 年 11 月 15 日	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	82,185,325.96 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	融通深证成份指数 A/B	融通深证成份指数 C
下属分级基金的交易代码	161612	004875
下属分级基金的前端交易代码	161612	-
下属分级基金的后端交易代码	161662	-
报告期末下属分级基金的份额总额	74,945,223.55 份	7,240,102.41 份

## 2.2 基金产品说明

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

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	融通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	涂卫东
	联系电话	(0755) 26948666
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com
客户服务电话	400-883-8088、(0755) 26948088	95588
传真	(0755) 26935005	(010) 66105798
注册地址	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14、15 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518053	100140
法定代表人	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	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	融通基金管理有限公司	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14、15 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	融通深证成份指数 A/B	融通深证成份指数 C
本期已实现收益	117,338.12	-3,585.18
本期利润	1,104,551.18	90,903.60
加权平均基金份额本期利润	0.0146	0.0133
本期加权平均净值利润率	1.40%	1.26%
本期基金份额净值增长率	1.38%	1.06%
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	1,628,331.41	231,974.92
期末可供分配基金份额利润	0.0217	0.0320
期末基金资产净值	76,573,554.96	7,472,077.33
期末基金份额净值	1.022	1.032
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	9.29%	21.25%

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

融通深证成份指数 A/B

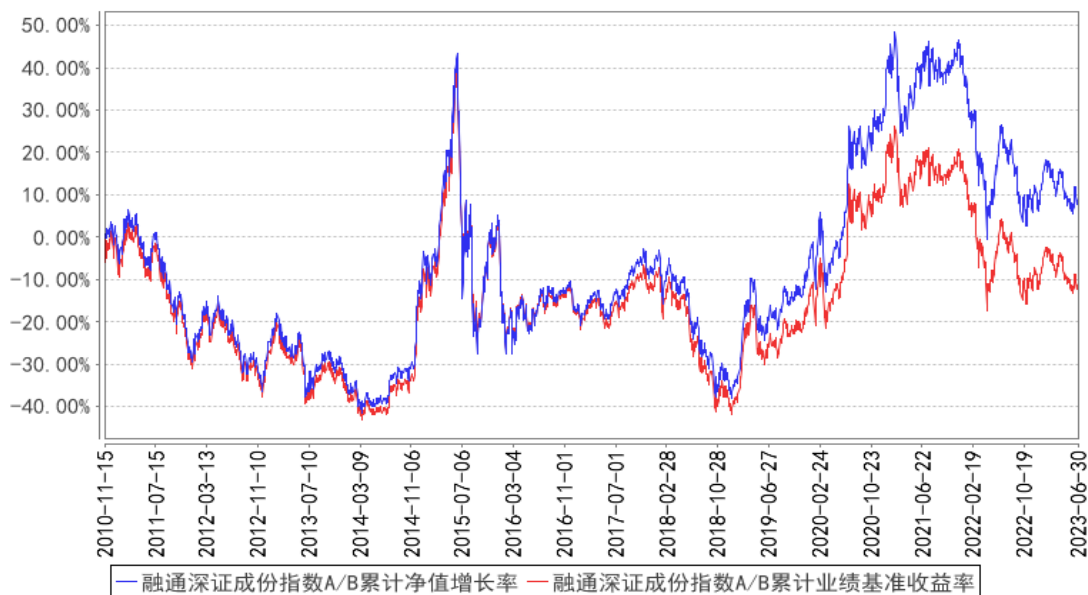
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.92%	1.03%	2.05%	1.01%	0.87%	0.02%
过去三个月	-4.13%	0.85%	-5.66%	0.86%	1.53%	-0.01%
过去六个月	1.38%	0.86%	0.12%	0.86%	1.26%	0.00%
过去一年	-12.86%	1.01%	-13.75%	1.01%	0.89%	0.00%
过去三年	1.34%	1.29%	-7.33%	1.26%	8.67%	0.03%
自基金合同生效起至今	9.29%	1.51%	-10.95%	1.47%	20.24%	0.04%

融通深证成份指数 C

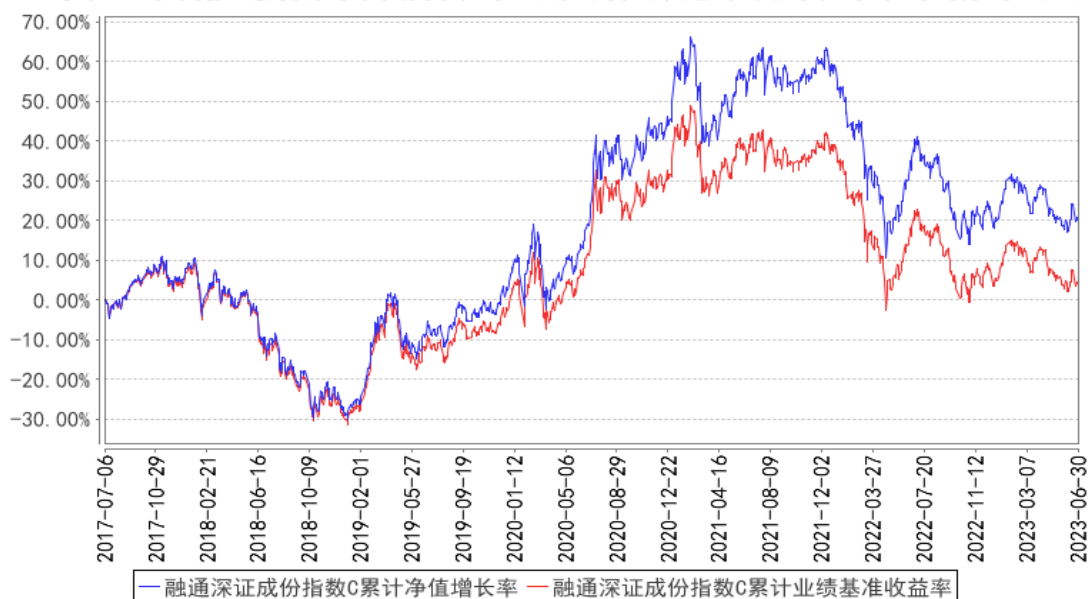
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.89%	1.04%	2.05%	1.01%	0.84%	0.03%
过去三个月	-4.27%	0.86%	-5.66%	0.86%	1.39%	0.00%
过去六个月	1.06%	0.86%	0.12%	0.86%	0.94%	0.00%
过去一年	-13.18%	1.01%	-13.75%	1.01%	0.57%	0.00%
过去三年	0.19%	1.29%	-7.33%	1.26%	7.52%	0.03%
自基金合同生效起至今	21.25%	1.35%	5.01%	1.33%	16.24%	0.02%

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

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



融通深证成份指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2017 年 7 月 5 日增设 C 类份额，该类份额首次确认日为 2017 年 7 月 6 日，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		
蔡志伟	本基金的基金经理	2016年11月19日	-	12	蔡志伟先生，计算机应用技术硕士，金融风险管理师（FRM），12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、融通量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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

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

无。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人

谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通深证成份指数 A/B 基金份额净值为 1.022 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.38%，同期业绩比较基准收益率为 0.12%；

截至本报告期末融通深证成份指数 C 基金份额净值为 1.032 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.06%，同期业绩比较基准收益率为 0.12%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年以来，市场在疫后恢复的“强预期”和经济的“弱现实”下，走出倒 V 型。2 月至今，市场板块快速轮动，主要原因为一季报以及各类宏观数据不及预期，盈利预期持续下调；叠加 4 月政治局会议释放出较弱的稳增长政策预期，以及地方城投事件，导致市场担忧通缩持续负反馈，市场情绪悲观；在悲观情绪主导下，万得全 A 月线 4 连阴。

在市场持续调整下，公募基金发行处历史底部，外资阶段性流出，印证市场情绪过度悲观，同时沪深 300 非金融的股债收益差向下触及 $-2X$  标准差，表明市场已对弱现实有了较为充分的定价，市场大概率已处于年内底部区域，短期内有望迎来反弹。

从行业层面来看，数字经济是全年的主线。AI 正处于新一轮科技周期起点，重点关注 AI 业绩开始兑现的算力，包括光模块、服务器以及 AI 芯片，以及 AI 赋能的游戏、广告营销等行业。

另外，若后续宏观政策层面有重大变化，白酒、地产链大概率有较强的底部反弹机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

估值委员会定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及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，融通深证成份指数 A/B 每 10 份基金份额派发红利 0.0200 元，融通深证成份指数 C 每 10 份基金份额派发红利 0.0300 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合规守信、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，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：融通深证成份指数证券投资基金

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	2,329,743.44	4,914,525.29
结算备付金		46,095.58	66,659.80
存出保证金		3,001.33	1,430.03
交易性金融资产	6.4.7.2	81,743,933.75	79,264,072.77
其中：股票投资		79,205,691.83	79,264,072.77
基金投资		-	-
债券投资		2,538,241.92	-
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		51,431.44	3,811.62
应收股利		-	-
应收申购款		56,285.25	17,207.89
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		84,230,490.79	84,267,707.40
<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		-	-
应付赎回款		8,700.11	74,961.03
应付管理人报酬		68,785.29	72,204.38
应付托管费		13,757.06	14,440.87
应付销售服务费		2,484.62	2,329.29
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	91,131.42	178,516.67
负债合计		184,858.50	342,452.24
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	82,185,325.96	82,968,964.88
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	1,860,306.33	956,290.28
净资产合计		84,045,632.29	83,925,255.16
负债和净资产总计		84,230,490.79	84,267,707.40

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 82,185,325.96 份，其中融通深证成份指数 A/B 类基金份额 74,945,223.55 份，基金份额净值 1.022 元；融通深证成份指数 C 类基金份额 7,240,102.41 份，基金份额净值 1.032 元。

## 6.2 利润表

会计主体：融通深证成份指数证券投资基金

本报告期：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 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
<b>一、营业总收入</b>		1,781,096.58	-12,261,242.06
1. 利息收入		6,251.55	3,807.87
其中：存款利息收入	6.4.7.13	6,251.55	3,807.87
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）		683,105.25	-118,035.23
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-104,704.39	-877,459.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	24,359.21	46,090.46
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	763,450.43	713,333.31
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	1,081,701.84	-12,155,862.34
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	10,037.94	8,847.64
<b>减：二、营业总支出</b>		585,641.80	639,122.23
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	428,485.38	454,121.28
2. 托管费	6.4.10.2.2	85,697.09	90,824.30
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	14,311.66	14,723.49
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	57,147.67	79,453.16
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,195,454.78	-12,900,364.29
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,195,454.78	-12,900,364.29
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		1,195,454.78	-12,900,364.29

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：融通深证成份指数证券投资基金

本报告期：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	82,968,964.88	-	956,290.28	83,925,255.16

金净值)				
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）	82,968,964.88	-	956,290.28	83,925,255.16
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-783,638.92	-	904,016.05	120,377.13
（一）、综合收益总额	-	-	1,195,454.78	1,195,454.78
（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）	-783,638.92	-	-119,577.29	-903,216.21
其中：1. 基金申购款	8,909,396.90	-	437,723.24	9,347,120.14
2. 基金赎回款	-9,693,035.82	-	-557,300.53	-10,250,336.35
（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）	-	-	-171,861.44	-171,861.44
（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）	82,185,325.96	-	1,860,306.33	84,045,632.29
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）	78,224,669.63	-	29,399,350.31	107,624,019.94
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）	78,224,669.63	-	29,399,350.31	107,624,019.94
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,235,227.41	-	-15,073,855.22	-11,838,627.81
（一）、综合收益总额	-	-	-12,900,364.29	-12,900,364.29
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动	3,235,227.41	-	664,872.98	3,900,100.39

数 (净值减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	11,112,031.75	-	1,650,074.86	12,762,106.61
2. 基金赎回款	-7,876,804.34	-	-985,201.88	-8,862,006.22
(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)	-	-	-2,838,363.91	-2,838,363.91
(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)	81,459,897.04	-	14,325,495.09	95,785,392.13

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>张帆</u>	<u>高翔</u>	<u>刘美丽</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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

根据本基金的基金管理人于2017年7月5日发布的《融通基金管理有限公司关于融通深证成份指数证券投资基金增设C类基金份额并修订基金合同部分条款的公告》,自2017年7月5日起对本基金进行份额分类,原有基金份额为A/B类份额,增设C类份额。在投资者申购时收取前端申购费用的份额,称为A类份额;在投资者赎回时收取后端申购费用的份额,称为B类份额;不



收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费并按照持有期限收取赎回费的份额，称为 C 类份额。本基金分类后，本基金原有基金份额将自动划归为本基金 A/B 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通深证成份指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括深证成份指数的成份股与备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金力求将净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内，以实现深证成份指数的有效跟踪。本基金标的指数使用费由基金管理人融通基金管理有限公司承担，不计入本基金费用。本基金股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，其中投资于深证成份指数成份股及其备选成份股的资产不低于股票资产的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：深证成份指数收益率 X95%+银行活期存款利率 X5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《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》、《融通深证成份指数证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(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	2,329,743.44
等于：本金	2,329,539.85
加：应计利息	203.59
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	2,329,743.44

##### 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	82,674,903.41	-	79,205,691.83	-3,469,211.58	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	2,506,224.95	22,991.97	2,538,241.92	9,025.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,506,224.95	22,991.97	2,538,241.92	9,025.00

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	85,181,128.36	22,991.97	81,743,933.75	-3,460,186.58

#### 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	-
应付赎回费	0.90
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	34,102.85
其中：交易所市场	34,102.85
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	57,027.67
合计	91,131.42

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

融通深证成份指数 A/B

项目	本期 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	76,271,730.32	76,271,730.32
本期申购	5,034,833.64	5,034,833.64
本期赎回（以“-”号填列）	-6,361,340.41	-6,361,340.41
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	74,945,223.55	74,945,223.55

融通深证成份指数 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	6,697,234.56	6,697,234.56
本期申购	3,874,563.26	3,874,563.26
本期赎回（以“-”号填列）	-3,331,695.41	-3,331,695.41
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	7,240,102.41	7,240,102.41

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

##### 融通深证成份指数 A/B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	43,918,404.55	-43,120,449.80	797,954.75
本期利润	117,338.12	987,213.06	1,104,551.18
本期基金份额交易产生的变动数	-760,918.35	638,766.52	-122,151.83
其中：基金申购款	2,895,712.45	-2,652,612.03	243,100.42
基金赎回款	-3,656,630.80	3,291,378.55	-365,252.25
本期已分配利润	-152,022.69	-	-152,022.69
本期末	43,122,801.63	-41,494,470.22	1,628,331.41

##### 融通深证成份指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	850,624.84	-692,289.31	158,335.53
本期利润	-3,585.18	94,488.78	90,903.60
本期基金份额交易产生的变动数	66,645.98	-64,071.44	2,574.54
其中：基金申购款	479,629.55	-285,006.73	194,622.82
基金赎回款	-412,983.57	220,935.29	-192,048.28
本期已分配利润	-19,838.75	-	-19,838.75
本期末	893,846.89	-661,871.97	231,974.92

#### 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	5,882.80
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	349.97
其他	18.78
合计	6,251.55

#### 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	-104,704.39
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	-104,704.39

#### 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	37,531,419.24
减：卖出股票成本总额	37,526,330.24
减：交易费用	109,793.39
买卖股票差价收入	-104,704.39

#### 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

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	15,424.90
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	8,934.31
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	24,359.21

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	38,340.74
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	29,399.85
减：应计利息总额	5.05
减：交易费用	1.53
买卖债券差价收入	8,934.31

##### 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	763,450.43
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	763,450.43
----	------------

## 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	1,081,701.84
股票投资	1,072,676.84
债券投资	9,025.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,081,701.84

## 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	9,295.94
基金转换费收入	742.00
合计	10,037.94

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

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

## 6.4.7.22 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	17,356.09
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	120.00
合计	57,147.67

#### 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

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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	428,485.38	454,121.28
其中：支付销售机构的客户维护费	200,512.87	213,677.76

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	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
当期发生的基金应支付的托管费	85,697.09	90,824.30

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		
	融通深证成份指数 A/B	融通深证成份指数 C	合计
融通基金	-	252.42	252.42
合计	-	252.42	252.42
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		
	融通深证成份指数 A/B	融通深证成份指数 C	合计
融通基金	-	313.66	313.66
合计	-	313.66	313.66

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 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	2,329,743.44	5,882.80	2,028,436.09	3,390.54

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

融通深证成份指数 A/B								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
		场内	场外					
1	2023年1月 16日	-	2023年1月16 日	0.0200	74,064.72	77,957.97	152,022.69	-
合计	-	-	-	0.0200	74,064.72	77,957.97	152,022.69	-
融通深证成份指数 C								
序号	权益	除息日		每 10 份基	现金形式	再投资形式	本期利润	备注

	登记日	场内	场外	基金份额数	发放总额	发放总额	分配合计	
1	2023年1月16日	-	2023年1月16日	0.0300	15,039.80	4,798.95	19,838.75	-
合计	-	-	-	0.0300	15,039.80	4,798.95	19,838.75	-

#### 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	2023-05-15	1-6个月 (含)	首发流通受限	27.93	33.03	27	754.11	891.81	-
001286	陕西能源	2023-03-31	1-6个月 (含)	首发流通受限	9.60	9.41	3,061	29,385.60	28,804.01	-
001287	中电港	2023-03-30	1-6个月 (含)	首发流通受限	11.88	21.02	90	1,069.20	1,891.80	-
001324	长青科技	2023-05-12	1-6个月 (含)	首发流通受限	18.88	19.60	39	736.32	764.40	-
001328	登康口腔	2023-03-29	1-6个月 (含)	首发流通受限	20.68	25.49	35	723.80	892.15	-
001360	南矿集团	2023-03-31	1-6个月 (含)	首发流通受限	15.38	14.87	49	753.62	728.63	-
001367	海森药业	2023-03-30	1-6个月 (含)	首发流通受限	44.48	39.48	16	711.68	631.68	-
001380	华纬科技	2023-05-09	1-6个月 (含)	首发流通受限	28.84	30.78	46	1,326.64	1,415.88	-
300804	广康生化	2023-06-15	1-6个月 (含)	首发流通受限	42.45	32.97	62	2,631.90	2,044.14	-
301141	中科磁业	2023-03-27	1-6个月 (含)	首发流通受限	41.20	42.69	73	3,007.60	3,116.37	-
301157	华塑科技	2023-03-01	1-6个月 (含)	首发流通受限	56.50	52.93	39	2,203.50	2,064.27	-
301170	锡南科技	2023-06-16	1-6个月 (含)	首发流通受限	34.00	34.93	57	1,938.00	1,991.01	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1个月内 (含)	首发流通受限	25.82	25.82	646	16,679.72	16,679.72	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1-6个月 (含)	首发流通受限	25.82	25.82	72	1,859.04	1,859.04	-
301203	国泰环保	2023-03-28	1-6个月 (含)	首发流通受限	46.13	34.40	60	2,767.80	2,064.00	-
301210	金杨股份	2023-06-21	1-6个月	首发流	57.88	49.17	47	2,720.36	2,310.99	-

			(含)	通受限						
301225	恒勃股份	2023-06-08	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	35.66	33.26	80	2,852.80	2,660.80	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	72.50	58.42	37	2,682.50	2,161.54	-
301260	格力博	2023-01-20	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	30.85	23.63	166	5,121.10	3,922.58	-
301261	恒工精密	2023-06-29	1 个月内 (含)	首发流 通受限	36.90	36.90	431	15,903.90	15,903.90	-
301261	恒工精密	2023-06-29	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	36.90	36.90	48	1,771.20	1,771.20	-
301262	海看股份	2023-06-13	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	30.22	25.50	106	3,203.32	2,703.00	-
301281	科源制药	2023-03-28	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	44.18	25.10	53	2,341.54	1,330.30	-
301281	科源制药	2023-05-26	1-6 个月 (含)	送股流 通受限	-	25.10	21	-	527.10	-
301291	明阳电气	2023-06-21	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	38.13	31.03	105	4,003.65	3,258.15	-
301292	海科新源	2023-06-29	1 个月内 (含)	首发流 通受限	19.99	19.99	1,257	25,127.43	25,127.43	-
301292	海科新源	2023-06-29	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	19.99	19.99	140	2,798.60	2,798.60	-
301293	三博脑科	2023-04-25	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	29.60	71.42	84	2,486.40	5,999.28	-
301295	美硕科技	2023-06-19	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	37.40	36.07	78	2,917.20	2,813.46	-
301301	川宁生物	2022-12-20	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	5.00	8.96	738	3,690.00	6,612.48	-
301303	真兰仪表	2023-02-13	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	26.80	22.32	159	4,261.20	3,548.88	-
301305	朗坤环境	2023-05-15	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	25.25	19.69	117	2,954.25	2,303.73	-
301307	美利信	2023-04-14	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	32.34	31.86	110	3,557.40	3,504.60	-
301315	威士顿	2023-06-13	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	32.29	51.12	68	2,195.72	3,476.16	-
301317	鑫磊股份	2023-01-12	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	20.67	26.17	198	4,092.66	5,181.66	-
301320	豪江智能	2023-06-01	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	13.06	20.62	219	2,860.14	4,515.78	-
301322	绿通科技	2023-02-27	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	131.11	53.24	27	3,539.97	1,437.48	-

301322	绿通科技	2023-05-25	1-6 个月 (含)	送股流 通受限	-	53.24	14	-	745.36	-
301323	新莱福	2023-05-29	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	39.06	39.36	46	1,796.76	1,810.56	-
301332	德尔玛	2023-05-09	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	14.81	13.73	176	2,606.56	2,416.48	-
301337	亚华电子	2023-05-16	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	32.60	30.37	58	1,890.80	1,761.46	-
301355	南王科技	2023-06-02	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	17.55	16.75	136	2,386.80	2,278.00	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	23.77	42.89	103	2,448.31	4,417.67	-
301360	荣旗科技	2023-04-17	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	71.88	92.60	34	2,443.92	3,148.40	-
301373	凌玮科技	2023-01-20	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	33.73	31.85	76	2,563.48	2,420.60	-
301376	致欧科技	2023-06-14	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	24.66	22.51	91	2,244.06	2,048.41	-
301382	蜂助手	2023-05-09	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	23.80	32.84	89	2,118.20	2,922.76	-
301386	未来电器	2023-03-21	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	29.99	23.79	86	2,579.14	2,045.94	-
301387	光大同创	2023-04-10	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	58.32	45.36	66	3,849.12	2,993.76	-
301395	仁信新材	2023-06-21	1 个月内 (含)	首发流 通受限	26.68	26.68	1,090	29,081.20	29,081.20	-
301395	仁信新材	2023-06-21	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	26.68	26.68	122	3,254.96	3,254.96	-
301397	溯联股份	2023-06-15	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	53.27	40.20	57	3,036.39	2,291.40	-
301399	英特科技	2023-05-16	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	43.99	51.57	65	2,859.35	3,352.05	-
301408	华人健康	2023-02-22	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	16.24	16.95	197	3,199.28	3,339.15	-
301419	阿莱德	2023-02-02	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	24.80	43.85	127	3,149.60	5,568.95	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	26.35	30.60	69	1,818.15	2,111.40	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	19.99	16.90	114	2,278.86	1,926.60	-
301486	致尚科技	2023-06-30	1 个月内 (含)	首发流 通受限	57.66	57.66	512	29,521.92	29,521.92	-
301486	致尚科技	2023-06-30	1-6 个月	首发流	57.66	57.66	57	3,286.62	3,286.62	-

			(含)	通受限						
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1 个月内 (含)	首发流 通受限	39.78	39.78	639	25,419.42	25,419.42	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	39.78	39.78	71	2,824.38	2,824.38	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限期	流通受 限类型	认购 价格	期末估值单 价	数量 (单位：张)	期末 成本总额	期末估值 总额	备注
127086	恒邦转债	2023 年 6 月 12 日	1-6 个月 (含)	新债未 上市	100.00	100.01	105	10,499.95	10,500.82	-

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

金额单位：人民币元

股票代 码	股票 名称	停牌 日期	停牌 原因	期末 估值单 价	复牌 日期	复牌 开盘单 价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
300346	南大光 电	2023 年 6 月 26 日	重大事 项停牌	34.39	-	-	3,200	108,616.00	110,048.00	-

注：本基金截至 2023 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时



停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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

本基金的基金管理人奉行内控优先和全员风险管理理念，高度重视风险管理的组织保障和制度保障，建立了完备的风险管理组织及相应的制度和流程，力争在风险最小化的前提下，确保基金份额持有人利益最大化。

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

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

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

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	2,527,741.10	-
合计	2,527,741.10	-

注：1、未评级部分为国债。

2、债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	10,500.82	-
未评级	-	-
合计	10,500.82	-

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 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 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 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、存出保证金和债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	2,329,743.44	-	-	-	2,329,743.44
结算备付金	46,095.58	-	-	-	46,095.58
存出保证金	3,001.33	-	-	-	3,001.33
交易性金融资产	2,527,741.10	0.00	10,500.82	79,205,691.83	81,743,933.75
应收申购款	-	-	-	56,285.25	56,285.25
应收清算款	-	-	-	51,431.44	51,431.44
资产总计	4,906,581.45	0.00	10,500.82	79,313,408.52	84,230,490.79
负债					
应付赎回款	-	-	-	8,700.11	8,700.11
应付管理人报酬	-	-	-	68,785.29	68,785.29
应付托管费	-	-	-	13,757.06	13,757.06
应付销售服务费	-	-	-	2,484.62	2,484.62
其他负债	-	-	-	91,131.42	91,131.42
负债总计	-	-	-	184,858.50	184,858.50
利率敏感度缺口	4,906,581.45	0.00	10,500.82	79,128,550.02	84,045,632.29
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	4,914,525.29	-	-	-	4,914,525.29
结算备付金	66,659.80	-	-	-	66,659.80
存出保证金	1,430.03	-	-	-	1,430.03
交易性金融资产	-	-	-	79,264,072.77	79,264,072.77
应收申购款	-	-	-	17,207.89	17,207.89
应收清算款	-	-	-	3,811.62	3,811.62
资产总计	4,982,615.12	-	-	79,285,092.28	84,267,707.40
负债					

应付赎回款	-	-	-	74,961.03	74,961.03
应付管理人报酬	-	-	-	72,204.38	72,204.38
应付托管费	-	-	-	14,440.87	14,440.87
应付销售服务费	-	-	-	2,329.29	2,329.29
其他负债	-	-	-	178,516.67	178,516.67
负债总计	-	-	-	342,452.24	342,452.24
利率敏感度缺口	4,982,615.12	-	-	-78,942,640.04	83,925,255.16

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

假设	除市场利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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）	
分析	1. 市场利率下降 25 个基点	3,546.49	-
	2. 市场利率上升 25 个基点	-3,537.47	-

注：于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产占基金资产的比例为

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	79,205,691.83	94.24	79,264,072.77	94.45
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	79,205,691.83	94.24	79,264,072.77	94.45

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除深证成份指数收益率以外的其他市场变量保持不变		
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）	
分析	深证成份指数收益率上升 5%	3,980,535.65	3,996,752.01
	深证成份指数收益率下降 5%	-3,980,535.65	-3,996,752.01

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 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	78,795,449.19	79,067,866.81
第二层次	2,685,269.49	31,968.00
第三层次	263,215.07	164,237.96
合计	81,743,933.75	79,264,072.77

##### 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

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	79,205,691.83	94.03



	其中：股票	79,205,691.83	94.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,538,241.92	3.01
	其中：债券	2,538,241.92	3.01
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,375,839.02	2.82
8	其他各项资产	110,718.02	0.13
9	合计	84,230,490.79	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,722,991.15	2.05
B	采矿业	636,524.40	0.76
C	制造业	59,708,622.62	71.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	578,113.00	0.69
E	建筑业	144,702.00	0.17
F	批发和零售业	518,536.93	0.62
G	交通运输、仓储和邮政业	1,016,897.00	1.21
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,645,668.90	6.72
J	金融业	4,613,331.77	5.49
K	房地产业	1,161,672.49	1.38
L	租赁和商务服务业	807,547.84	0.96
M	科学研究和技术服务业	654,976.00	0.78
N	水利、环境和公共设施管理业	167,083.00	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	54,520.00	0.06
Q	卫生和社会工作	871,229.25	1.04
R	文化、体育和娱乐业	538,362.40	0.64
S	综合	6,035.00	0.01
	合计	78,846,813.75	93.81

### 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	299,452.92	0.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	28,804.01	0.03
E	建筑业	-	-

F	批发和零售业	7,279.36	0.01
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	12,974.78	0.02
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	4,367.73	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	5,999.28	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	358,878.08	0.43

### 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	17,760	4,063,310.40	4.83
2	000858	五粮液	12,646	2,068,506.22	2.46
3	000333	美的集团	32,103	1,891,508.76	2.25
4	002594	比亚迪	5,744	1,483,502.88	1.77
5	300059	东方财富	87,969	1,249,159.80	1.49
6	000651	格力电器	33,702	1,230,460.02	1.46
7	000063	中兴通讯	25,077	1,142,006.58	1.36
8	300760	迈瑞医疗	3,700	1,109,260.00	1.32
9	000568	泸州老窖	5,143	1,077,818.51	1.28
10	002475	立讯精密	31,757	1,030,514.65	1.23
11	002230	科大讯飞	13,963	948,925.48	1.13
12	300274	阳光电源	7,860	916,711.80	1.09
13	000725	京东方 A	219,298	896,928.82	1.07
14	002415	海康威视	26,535	878,573.85	1.05
15	300124	汇川技术	12,647	812,063.87	0.97
16	300308	中际旭创	5,020	740,199.00	0.88
17	002371	北方华创	2,300	730,595.00	0.87
18	002714	牧原股份	17,275	728,141.25	0.87
19	002352	顺丰控股	16,000	721,440.00	0.86
20	002129	TCL 中环	20,500	680,600.00	0.81

21	300498	温氏股份	37,078	680,381.30	0.81
22	000001	平安银行	59,209	664,917.07	0.79
23	000002	万科A	44,800	628,096.00	0.75
24	002142	宁波银行	24,723	625,491.90	0.74
25	300014	亿纬锂能	9,578	579,469.00	0.69
26	002459	晶澳科技	13,408	559,113.60	0.67
27	002304	洋河股份	4,135	543,132.25	0.65
28	300015	爱尔眼科	29,215	541,938.25	0.64
29	000792	盐湖股份	25,800	494,586.00	0.59
30	002555	三七互娱	13,900	484,832.00	0.58
31	002050	三花智控	15,883	480,619.58	0.57
32	000938	紫光股份	15,075	480,138.75	0.57
33	002027	分众传媒	70,464	479,859.84	0.57
34	002460	赣锋锂业	7,810	476,097.60	0.57
35	000977	浪潮信息	9,664	468,704.00	0.56
36	002466	天齐锂业	6,700	468,397.00	0.56
37	000338	潍柴动力	34,440	429,122.40	0.51
38	002049	紫光国微	4,540	423,355.00	0.50
39	300316	晶盛机电	5,920	419,728.00	0.50
40	300502	新易盛	6,041	410,606.77	0.49
41	002271	东方雨虹	13,543	369,182.18	0.44
42	002812	恩捷股份	3,800	366,130.00	0.44
43	002602	世纪华通	47,400	359,766.00	0.43
44	000625	长安汽车	27,809	359,570.37	0.43
45	000100	TCL 科技	89,452	352,440.88	0.42
46	002709	天赐材料	8,552	352,256.88	0.42
47	002236	大华股份	17,832	352,182.00	0.42
48	002410	广联达	10,600	344,394.00	0.41
49	002179	中航光电	7,557	342,709.95	0.41
50	300122	智飞生物	7,700	340,340.00	0.40
51	002422	科伦药业	10,816	321,018.88	0.38
52	000166	申万宏源	69,320	320,258.40	0.38
53	300033	同花顺	1,800	315,504.00	0.38
54	002384	东山精密	11,850	306,915.00	0.37
55	300142	沃森生物	11,600	306,820.00	0.37
56	002241	歌尔股份	17,114	303,773.50	0.36
57	000988	华工科技	7,800	296,478.00	0.35
58	000776	广发证券	19,660	289,198.60	0.34
59	300450	先导智能	7,941	287,225.97	0.34
60	000661	长春高新	2,094	285,412.20	0.34
61	300418	昆仑万维	6,800	273,904.00	0.33
62	002558	巨人网络	15,000	268,950.00	0.32
63	300896	爱美客	600	266,970.00	0.32

64	001979	招商蛇口	20,463	266,632.89	0.32
65	002463	沪电股份	12,720	266,356.80	0.32
66	000538	云南白药	5,059	265,496.32	0.32
67	000423	东阿阿胶	4,800	256,560.00	0.31
68	002311	海大集团	5,440	254,809.60	0.30
69	300408	三环集团	8,650	253,877.50	0.30
70	000768	中航西飞	9,460	253,055.00	0.30
71	000425	徐工机械	37,100	251,167.00	0.30
72	000733	振华科技	2,600	249,210.00	0.30
73	000596	古井贡酒	1,000	247,380.00	0.29
74	002493	荣盛石化	21,100	245,604.00	0.29
75	300347	泰格医药	3,750	242,025.00	0.29
76	300777	中简科技	5,100	241,026.00	0.29
77	002648	卫星化学	15,686	234,662.56	0.28
78	300496	中科创达	2,400	231,240.00	0.28
79	002368	太极股份	5,600	230,552.00	0.27
80	000157	中联重科	34,141	230,451.75	0.27
81	000963	华东医药	5,300	229,861.00	0.27
82	002600	领益智造	32,500	224,575.00	0.27
83	002436	兴森科技	14,300	221,650.00	0.26
84	300413	芒果超媒	6,440	220,312.40	0.26
85	002624	完美世界	13,000	219,570.00	0.26
86	300633	开立医疗	4,000	218,000.00	0.26
87	002340	格林美	31,510	217,734.10	0.26
88	300487	蓝晓科技	3,450	215,349.00	0.26
89	002603	以岭药业	8,315	213,612.35	0.25
90	002180	纳思达	6,200	212,350.00	0.25
91	002402	和而泰	12,300	208,854.00	0.25
92	300782	卓胜微	2,104	203,309.52	0.24
93	000921	海信家电	7,500	202,125.00	0.24
94	002518	科士达	5,000	200,050.00	0.24
95	000807	云铝股份	15,700	199,861.00	0.24
96	300661	圣邦股份	2,405	197,522.65	0.24
97	002202	金风科技	18,588	197,404.56	0.23
98	300012	华测检测	10,100	196,950.00	0.23
99	000066	中国长城	14,228	196,773.24	0.23
100	000997	新大陆	10,400	196,560.00	0.23
101	002252	上海莱士	26,100	196,011.00	0.23
102	300003	乐普医疗	8,600	194,446.00	0.23
103	000876	新希望	16,600	193,888.00	0.23
104	300724	捷佳伟创	1,700	190,995.00	0.23
105	002074	国轩高科	6,900	190,578.00	0.23
106	000951	中国重汽	11,220	189,057.00	0.22

107	002001	新 和 成	12,145	187,033.00	0.22
108	000895	双汇发展	7,617	186,540.33	0.22
109	002223	鱼跃医疗	5,100	183,549.00	0.22
110	300751	迈为股份	1,079	182,761.02	0.22
111	300454	深信服	1,600	181,200.00	0.22
112	002405	四维图新	15,600	180,648.00	0.21
113	002085	万丰奥威	25,800	178,794.00	0.21
114	002601	龙佰集团	10,800	178,200.00	0.21
115	002738	中矿资源	3,400	173,196.00	0.21
116	002028	思源电气	3,700	172,864.00	0.21
117	000786	北新建材	6,996	171,471.96	0.20
118	002920	德赛西威	1,100	171,391.00	0.20
119	300146	汤臣倍健	7,100	170,258.00	0.20
120	002736	国信证券	19,400	169,362.00	0.20
121	002156	通富微电	7,400	167,240.00	0.20
122	300999	金龙鱼	4,142	165,638.58	0.20
123	300037	新宙邦	3,180	165,010.20	0.20
124	300058	蓝色光标	16,900	163,423.00	0.19
125	002007	华兰生物	7,285	163,256.85	0.19
126	300285	国瓷材料	5,900	161,660.00	0.19
127	000301	东方盛虹	13,500	159,570.00	0.19
128	000999	华润三九	2,600	157,716.00	0.19
129	002008	大族激光	6,000	157,200.00	0.19
130	002821	凯莱英	1,320	155,575.20	0.19
131	000630	铜陵有色	53,600	154,904.00	0.18
132	002185	华天科技	16,834	154,872.80	0.18
133	300433	蓝思科技	13,160	154,761.60	0.18
134	002385	大北农	23,250	153,450.00	0.18
135	003816	中国广核	48,900	152,079.00	0.18
136	300769	德方纳米	1,376	151,676.48	0.18
137	300223	北京君正	1,700	150,127.00	0.18
138	002563	森马服饰	24,000	149,280.00	0.18
139	300395	菲利华	3,000	147,600.00	0.18
140	300073	当升科技	2,900	145,957.00	0.17
141	000932	华菱钢铁	30,380	144,912.60	0.17
142	000799	酒鬼酒	1,600	144,240.00	0.17
143	300474	景嘉微	1,600	143,984.00	0.17
144	300253	卫宁健康	13,285	143,743.70	0.17
145	300759	康龙化成	3,750	143,550.00	0.17
146	000933	神火股份	11,000	143,000.00	0.17
147	002044	美年健康	20,100	142,911.00	0.17
148	002797	第一创业	24,720	141,398.40	0.17
149	300144	宋城演艺	11,400	141,360.00	0.17

150	000975	银泰黄金	12,072	141,242.40	0.17
151	300763	锦浪科技	1,350	140,535.00	0.17
152	002841	视源股份	2,100	140,364.00	0.17
153	002439	启明星辰	4,700	139,872.00	0.17
154	300476	胜宏科技	5,700	137,427.00	0.16
155	000683	远兴能源	19,000	136,610.00	0.16
156	002568	百润股份	3,752	136,385.20	0.16
157	300024	机器人	8,100	135,027.00	0.16
158	002273	水晶光电	11,300	134,922.00	0.16
159	000783	长江证券	23,225	134,705.00	0.16
160	300567	精测电子	1,400	133,210.00	0.16
161	300390	天华新能	3,620	129,596.00	0.15
162	002025	航天电器	2,021	128,939.80	0.15
163	000983	山西焦煤	13,900	126,490.00	0.15
164	300118	东方日升	4,900	125,587.00	0.15
165	002407	多氟多	6,320	125,515.20	0.15
166	000728	国元证券	19,190	125,118.80	0.15
167	000738	航发控制	5,051	123,244.40	0.15
168	002078	太阳纸业	11,400	121,866.00	0.14
169	002465	海格通信	11,730	121,288.20	0.14
170	300054	鼎龙股份	4,900	121,177.00	0.14
171	002497	雅化集团	6,800	120,904.00	0.14
172	300568	星源材质	6,991	120,175.29	0.14
173	002850	科达利	900	119,025.00	0.14
174	000860	顺鑫农业	3,500	117,915.00	0.14
175	000069	华侨城 A	26,544	116,793.60	0.14
176	002409	雅克科技	1,600	116,608.00	0.14
177	002472	双环传动	3,200	116,160.00	0.14
178	002756	永兴材料	1,850	115,828.50	0.14
179	002268	电科网安	4,100	114,267.00	0.14
180	002262	恩华药业	3,700	114,071.00	0.14
181	300604	长川科技	2,400	113,976.00	0.14
182	300628	亿联网络	3,210	112,574.70	0.13
183	300601	康泰生物	4,400	111,716.00	0.13
184	300017	网宿科技	15,700	111,627.00	0.13
185	000729	燕京啤酒	8,900	110,983.00	0.13
186	000998	隆平高科	7,200	110,520.00	0.13
187	300438	鹏辉能源	2,300	110,492.00	0.13
188	002739	万达电影	8,800	110,352.00	0.13
189	300346	南大光电	3,200	110,048.00	0.13
190	002430	杭氧股份	3,200	109,952.00	0.13
191	002673	西部证券	17,248	109,524.80	0.13
192	002444	巨星科技	5,000	109,400.00	0.13

193	300699	光威复材	3,541	109,239.85	0.13
194	300136	信维通信	5,395	108,331.60	0.13
195	300595	欧普康视	3,580	108,080.20	0.13
196	000021	深科技	5,400	107,946.00	0.13
197	002281	光迅科技	2,900	107,561.00	0.13
198	000960	锡业股份	6,900	107,295.00	0.13
199	002195	二三四五	37,000	106,930.00	0.13
200	002865	钧达股份	700	106,771.00	0.13
201	000703	恒逸石化	15,700	106,446.00	0.13
202	300832	新产业	1,800	106,200.00	0.13
203	002294	信立泰	3,400	106,046.00	0.13
204	002065	东华软件	15,000	105,900.00	0.13
205	300383	光环新网	9,800	105,350.00	0.13
206	002916	深南电路	1,393	104,990.41	0.12
207	002507	涪陵榨菜	5,720	104,733.20	0.12
208	002353	杰瑞股份	4,151	104,314.63	0.12
209	002080	中材科技	5,060	103,831.20	0.12
210	000519	中兵红箭	5,700	103,113.00	0.12
211	002373	千方科技	7,500	102,300.00	0.12
212	002056	横店东磁	5,600	101,976.00	0.12
213	000400	许继电气	4,400	101,420.00	0.12
214	300558	贝达药业	2,100	100,863.00	0.12
215	002138	顺络电子	4,200	100,422.00	0.12
216	002152	广电运通	8,475	99,327.00	0.12
217	000516	国际医学	11,800	99,238.00	0.12
218	000032	深桑达 A	3,000	98,700.00	0.12
219	000708	中信特钢	6,170	97,732.80	0.12
220	000591	太阳能	14,400	97,632.00	0.12
221	002938	鹏鼎控股	4,000	97,160.00	0.12
222	002683	广东宏大	3,300	97,152.00	0.12
223	300459	汤姆猫	14,900	96,701.00	0.12
224	000513	丽珠集团	2,458	95,640.78	0.11
225	002389	航天彩虹	4,300	95,503.00	0.11
226	002532	天山铝业	15,900	95,241.00	0.11
227	000547	航天发展	9,400	94,000.00	0.11
228	002203	海亮股份	7,800	93,678.00	0.11
229	002557	洽洽食品	2,241	93,113.55	0.11
230	002414	高德红外	11,826	91,888.02	0.11
231	000762	西藏矿业	3,100	91,853.00	0.11
232	002595	豪迈科技	2,600	91,338.00	0.11
233	002851	麦格米特	2,500	91,175.00	0.11
234	002120	韵达股份	9,500	90,820.00	0.11
235	002372	伟星新材	4,400	90,376.00	0.11

236	300458	全志科技	3,300	89,925.00	0.11
237	000623	吉林敖东	5,600	89,824.00	0.11
238	002926	华西证券	10,800	89,748.00	0.11
239	000039	中集集团	12,950	89,225.50	0.11
240	000408	藏格矿业	3,900	88,023.00	0.10
241	002151	北斗星通	2,500	87,900.00	0.10
242	300296	利亚德	13,400	87,502.00	0.10
243	000878	云南铜业	7,900	87,295.00	0.10
244	300244	迪安诊断	3,400	87,142.00	0.10
245	002064	华峰化学	12,600	86,436.00	0.10
246	300682	朗新科技	3,700	86,136.00	0.10
247	002508	老板电器	3,400	85,986.00	0.10
248	002456	欧菲光	15,300	85,680.00	0.10
249	002541	鸿路钢构	2,940	84,701.40	0.10
250	000970	中科三环	6,600	84,612.00	0.10
251	002092	中泰化学	13,100	84,495.00	0.10
252	000636	风华高科	5,500	84,370.00	0.10
253	002747	埃斯顿	3,000	84,000.00	0.10
254	002531	天顺风能	5,500	83,765.00	0.10
255	002131	利欧股份	36,300	83,490.00	0.10
256	002299	圣农发展	4,300	82,345.00	0.10
257	300088	长信科技	13,600	82,008.00	0.10
258	000690	宝新能源	11,600	81,432.00	0.10
259	300009	安科生物	8,116	81,160.00	0.10
260	000060	中金岭南	17,000	80,750.00	0.10
261	300357	我武生物	2,401	80,745.63	0.10
262	000877	天山股份	9,900	80,586.00	0.10
263	002572	索菲亚	4,600	80,132.00	0.10
264	002153	石基信息	5,720	80,080.00	0.10
265	300957	贝泰妮	900	79,992.00	0.10
266	002484	江海股份	3,700	78,773.00	0.09
267	300866	安克创新	900	78,750.00	0.09
268	002212	天融信	8,100	78,570.00	0.09
269	300919	中伟股份	1,300	78,325.00	0.09
270	000830	鲁西化工	7,400	78,144.00	0.09
271	300803	指南针	1,600	77,744.00	0.09
272	002500	山西证券	13,800	77,004.00	0.09
273	002643	万润股份	4,300	74,863.00	0.09
274	300034	钢研高纳	1,900	74,841.00	0.09
275	300001	特锐德	3,600	74,808.00	0.09
276	300748	金力永磁	2,500	74,800.00	0.09
277	300666	江丰电子	1,100	74,756.00	0.09
278	000739	普洛药业	4,200	74,508.00	0.09



279	300363	博腾股份	2,500	73,975.00	0.09
280	000875	吉电股份	13,700	73,843.00	0.09
281	000778	新兴铸管	18,000	73,440.00	0.09
282	002019	亿帆医药	5,000	73,000.00	0.09
283	300294	博雅生物	2,000	72,560.00	0.09
284	300529	健帆生物	3,110	72,089.80	0.09
285	000893	亚钾国际	3,100	71,114.00	0.08
286	000686	东北证券	10,100	70,094.00	0.08
287	002408	齐翔腾达	11,000	70,070.00	0.08
288	301236	软通动力	2,550	69,385.50	0.08
289	300373	扬杰科技	1,700	68,969.00	0.08
290	300456	赛微电子	2,800	68,544.00	0.08
291	300677	英科医疗	3,100	68,200.00	0.08
292	000403	派林生物	3,400	67,864.00	0.08
293	002396	星网锐捷	3,000	67,770.00	0.08
294	002128	电投能源	5,100	67,422.00	0.08
295	002429	兆驰股份	12,200	67,100.00	0.08
296	002244	滨江集团	7,600	67,032.00	0.08
297	002245	蔚蓝锂芯	6,100	66,795.00	0.08
298	000887	中鼎股份	5,100	66,759.00	0.08
299	002155	湖南黄金	5,445	66,429.00	0.08
300	300251	光线传媒	8,200	66,338.00	0.08
301	300026	红日药业	12,200	66,124.00	0.08
302	002831	裕同科技	2,700	65,853.00	0.08
303	300674	宇信科技	3,720	65,769.60	0.08
304	300451	创业慧康	7,785	65,238.30	0.08
305	002249	大洋电机	11,400	64,980.00	0.08
306	300070	碧水源	12,000	64,320.00	0.08
307	002183	怡亚通	12,600	64,260.00	0.08
308	301269	华大九天	523	64,245.32	0.08
309	002312	川发龙蟒	7,800	63,414.00	0.08
310	002266	浙富控股	15,100	62,363.00	0.07
311	002675	东诚药业	4,200	61,782.00	0.07
312	000028	国药一致	1,413	61,620.93	0.07
313	000810	创维数字	3,800	61,446.00	0.07
314	002727	一心堂	2,300	60,720.00	0.07
315	002706	良信股份	5,339	60,063.75	0.07
316	300638	广和通	2,640	59,875.20	0.07
317	000581	威孚高科	3,800	59,850.00	0.07
318	003022	联泓新科	2,400	59,760.00	0.07
319	000422	湖北宜化	5,200	59,696.00	0.07
320	000027	深圳能源	8,900	58,651.00	0.07
321	002487	大金重工	1,900	58,596.00	0.07

322	000709	河钢股份	25,900	58,534.00	0.07
323	301050	雷电微力	900	58,437.00	0.07
324	002701	奥瑞金	12,920	58,269.20	0.07
325	002791	坚朗五金	900	58,239.00	0.07
326	002690	美亚光电	2,240	57,680.00	0.07
327	000528	柳工	7,300	57,670.00	0.07
328	300773	拉卡拉	3,300	57,552.00	0.07
329	002250	联化科技	5,500	57,530.00	0.07
330	001227	兰州银行	20,000	57,200.00	0.07
331	002984	森麒麟	1,800	56,628.00	0.07
332	000012	南玻 A	9,300	55,428.00	0.07
333	002032	苏泊尔	1,100	55,000.00	0.07
334	300747	锐科激光	1,800	54,864.00	0.07
335	001965	招商公路	5,700	54,720.00	0.07
336	000401	冀东水泥	7,400	54,538.00	0.06
337	002607	中公教育	11,600	54,520.00	0.06
338	002939	长城证券	6,700	54,471.00	0.06
339	300298	三诺生物	2,000	54,080.00	0.06
340	000785	居然之家	14,100	53,721.00	0.06
341	002221	东华能源	6,200	53,630.00	0.06
342	300979	华利集团	1,100	53,614.00	0.06
343	002124	天邦食品	11,800	53,572.00	0.06
344	002867	周大生	3,000	53,340.00	0.06
345	300725	药石科技	1,100	53,273.00	0.06
346	003031	中瓷电子	400	53,248.00	0.06
347	300679	电连技术	1,600	52,880.00	0.06
348	300115	长盈精密	4,379	52,153.89	0.06
349	002597	金禾实业	2,200	51,920.00	0.06
350	300776	帝尔激光	800	51,920.00	0.06
351	300618	寒锐钴业	1,600	51,856.00	0.06
352	002985	北摩高科	1,174	51,796.88	0.06
353	002099	海翔药业	6,000	51,540.00	0.06
354	002511	中顺洁柔	4,600	51,290.00	0.06
355	002745	木林森	5,500	50,600.00	0.06
356	002091	江苏国泰	6,600	49,764.00	0.06
357	002191	劲嘉股份	8,200	49,364.00	0.06
358	300850	新强联	1,300	48,594.00	0.06
359	300685	艾德生物	1,980	48,034.80	0.06
360	000555	神州信息	3,900	47,970.00	0.06
361	300482	万孚生物	1,780	47,401.40	0.06
362	301035	润丰股份	600	47,142.00	0.06
363	300623	捷捷微电	2,600	47,112.00	0.06
364	300463	迈克生物	3,100	46,872.00	0.06

365	300888	稳健医疗	1,120	46,670.40	0.06
366	002010	传化智联	8,700	46,284.00	0.06
367	000902	新洋丰	4,500	46,260.00	0.06
368	002081	金螳螂	10,200	46,002.00	0.05
369	000937	冀中能源	7,200	45,936.00	0.05
370	300457	赢合科技	2,600	45,916.00	0.05
371	000598	兴蓉环境	8,400	45,612.00	0.05
372	002468	申通快递	4,200	45,444.00	0.05
373	001914	招商积余	3,000	45,150.00	0.05
374	000089	深圳机场	6,400	44,480.00	0.05
375	002048	宁波华翔	3,200	42,880.00	0.05
376	002625	光启技术	2,800	42,728.00	0.05
377	000712	锦龙股份	3,400	42,432.00	0.05
378	002237	恒邦股份	3,800	41,382.00	0.05
379	002434	万里扬	4,600	41,170.00	0.05
380	300973	立高食品	600	41,052.00	0.05
381	002906	华阳集团	1,200	41,028.00	0.05
382	300257	开山股份	2,700	40,959.00	0.05
383	300171	东富龙	1,800	40,950.00	0.05
384	000967	盈峰环境	8,000	40,400.00	0.05
385	300737	科顺股份	4,400	40,304.00	0.05
386	300726	宏达电子	900	40,248.00	0.05
387	000898	鞍钢股份	14,300	39,754.00	0.05
388	002626	金达威	2,100	39,459.00	0.05
389	300207	欣旺达	2,402	39,200.64	0.05
390	301155	海力风电	500	38,540.00	0.05
391	002041	登海种业	2,500	38,175.00	0.05
392	002967	广电计量	1,900	38,171.00	0.05
393	000402	金融街	8,400	37,968.00	0.05
394	300630	普利制药	1,935	37,829.25	0.05
395	002216	三全食品	2,400	37,392.00	0.04
396	000539	粤电力 A	5,000	36,500.00	0.04
397	002925	盈趣科技	1,770	34,338.00	0.04
398	301047	义翘神州	400	34,280.00	0.04
399	002705	新宝股份	1,900	34,257.00	0.04
400	002110	三钢闽光	7,900	33,338.00	0.04
401	000959	首钢股份	9,400	32,900.00	0.04
402	001872	招商港口	1,900	32,813.00	0.04
403	000966	长源电力	5,800	32,364.00	0.04
404	300428	立中集团	1,400	32,284.00	0.04
405	301071	力量钻石	720	31,680.00	0.04
406	000672	上峰水泥	3,360	30,676.80	0.04
407	002242	九阳股份	2,000	29,900.00	0.04

408	300761	立华股份	1,620	29,856.60	0.04
409	300841	康华生物	450	29,650.50	0.04
410	301029	怡合达	652	29,131.36	0.03
411	000935	四川双马	1,700	28,628.00	0.03
412	002653	海思科	1,200	28,320.00	0.03
413	002320	海峡股份	4,500	27,180.00	0.03
414	000062	深圳华强	2,300	26,266.00	0.03
415	301078	孩子王	2,200	25,146.00	0.03
416	002461	珠江啤酒	2,600	22,906.00	0.03
417	300894	火星人	600	15,324.00	0.02
418	002176	江特电机	1,100	13,112.00	0.02
419	002901	大博医疗	400	12,432.00	0.01
420	301177	迪阿股份	300	11,529.00	0.01
421	301207	华兰疫苗	300	9,978.00	0.01
422	000009	中国宝安	500	6,035.00	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	301486	致尚科技	569	32,808.54	0.04
2	301395	仁信新材	1,212	32,336.16	0.04
3	301295	美硕科技	772	29,414.48	0.03
4	001286	陕西能源	3,061	28,804.01	0.03
5	301488	豪恩汽电	710	28,243.80	0.03
6	301292	海科新源	1,397	27,926.03	0.03
7	301397	溯联股份	566	23,873.00	0.03
8	301202	朗威股份	718	18,538.76	0.02
9	301261	恒工精密	479	17,675.10	0.02
10	301301	川宁生物	738	6,612.48	0.01
11	301293	三博脑科	84	5,999.28	0.01
12	301419	阿莱德	127	5,568.95	0.01
13	301317	鑫磊股份	198	5,181.66	0.01
14	301320	豪江智能	219	4,515.78	0.01
15	301358	湖南裕能	103	4,417.67	0.01
16	301260	格力博	166	3,922.58	0.00
17	301303	真兰仪表	159	3,548.88	0.00
18	301307	美利信	110	3,504.60	0.00
19	301315	威士顿	68	3,476.16	0.00
20	301399	英特科技	65	3,352.05	0.00
21	301408	华人健康	197	3,339.15	0.00
22	301291	明阳电气	105	3,258.15	0.00
23	301360	荣旗科技	34	3,148.40	0.00
24	301141	中科磁业	73	3,116.37	0.00
25	301387	光大同创	66	2,993.76	0.00

26	301382	蜂助手	89	2,922.76	0.00
27	301262	海看股份	106	2,703.00	0.00
28	301225	恒勃股份	80	2,660.80	0.00
29	301373	凌玮科技	76	2,420.60	0.00
30	301332	德尔玛	176	2,416.48	0.00
31	301210	金杨股份	47	2,310.99	0.00
32	301305	朗坤环境	117	2,303.73	0.00
33	301355	南王科技	136	2,278.00	0.00
34	301322	绿通科技	41	2,182.84	0.00
35	301232	飞沃科技	37	2,161.54	0.00
36	301428	世纪恒通	69	2,111.40	0.00
37	301157	华塑科技	39	2,064.27	0.00
38	301203	国泰环保	60	2,064.00	0.00
39	301376	致欧科技	91	2,048.41	0.00
40	301386	未来电器	86	2,045.94	0.00
41	300804	广康生化	62	2,044.14	0.00
42	301170	锡南科技	57	1,991.01	0.00
43	301439	泓淋电力	114	1,926.60	0.00
44	001287	中电港	90	1,891.80	0.00
45	301281	科源制药	74	1,857.40	0.00
46	301323	新莱福	46	1,810.56	0.00
47	301337	亚华电子	58	1,761.46	0.00
48	001380	华纬科技	46	1,415.88	0.00
49	001328	登康口腔	35	892.15	0.00
50	001282	三联锻造	27	891.81	0.00
51	001324	长青科技	39	764.40	0.00
52	001360	南矿集团	49	728.63	0.00
53	001367	海森药业	16	631.68	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	1,157,797.00	1.38
2	000858	五粮液	662,852.00	0.79
3	002493	荣盛石化	614,360.00	0.73
4	000301	东方盛虹	383,004.00	0.46
5	002518	科士达	378,057.00	0.45
6	000703	恒逸石化	362,761.00	0.43
7	002230	科大讯飞	339,623.00	0.40
8	300438	鹏辉能源	316,675.00	0.38
9	000878	云南铜业	311,977.00	0.37
10	300699	光威复材	299,742.00	0.36

11	000983	山西焦煤	296,928.00	0.35
12	001286	陕西能源	293,808.00	0.35
13	002368	太极股份	293,766.00	0.35
14	000997	新大陆	292,119.00	0.35
15	002472	双环传动	280,100.00	0.33
16	002405	四维图新	278,061.00	0.33
17	300316	晶盛机电	270,363.00	0.32
18	300124	汇川技术	265,871.00	0.32
19	000063	中兴通讯	262,292.00	0.31
20	300777	中简科技	261,725.00	0.31

注：“买入金额”是指买入股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	944,350.00	1.13
2	300750	宁德时代	848,769.00	1.01
3	002493	荣盛石化	633,143.25	0.75
4	000333	美的集团	466,712.00	0.56
5	000878	云南铜业	446,971.00	0.53
6	002475	立讯精密	421,852.00	0.50
7	001286	陕西能源	410,405.60	0.49
8	002594	比亚迪	397,048.00	0.47
9	000568	泸州老窖	365,607.00	0.44
10	300124	汇川技术	360,688.00	0.43
11	000301	东方盛虹	343,976.00	0.41
12	002304	洋河股份	339,924.00	0.41
13	000703	恒逸石化	337,402.44	0.40
14	002714	牧原股份	323,683.00	0.39
15	002410	广联达	318,887.00	0.38
16	000983	山西焦煤	318,328.00	0.38
17	000933	神火股份	305,664.00	0.36
18	300014	亿纬锂能	304,024.00	0.36
19	002049	紫光国微	299,482.00	0.36
20	002048	宁波华翔	286,861.00	0.34

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	36,395,272.46
卖出股票收入（成交）总额	37,531,419.24

注：表中“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均指成交金额，

即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	2,527,741.10	3.01
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）	10,500.82	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,538,241.92	3.02

#### 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	019694	23 国债 01	25,000	2,527,741.10	3.01
2	127086	恒邦转债	105	10,500.82	0.01

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

#### 7.10 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	3,001.33
2	应收清算款	51,431.44
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	56,285.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	110,718.02

### 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

无。

### 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 (%)
融通深证成份指数 A/B	5,041	14,867.13	-	-	74,945,223.55	100.00
融通深证成份指数 C	1,815	3,989.04	117,375.88	1.62	7,122,726.53	98.38
合计	6,856	11,987.36	117,375.88	0.14	82,067,950.08	99.86

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	融通深证成份指数 A/B	48,767.81	0.06507
	融通深证成份指数 C	81.92	0.00113
	合计	48,849.73	0.05944

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通深证成份指数 A/B	融通深证成份指数 C
基金合同生效日（2010年11月15日）基金份额总额	1,848,841,553.44	-
本报告期期初基金份额总额	76,271,730.32	6,697,234.56
本报告期基金总申购份额	5,034,833.64	3,874,563.26
减：本报告期基金总赎回份额	6,361,340.41	3,331,695.41
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	74,945,223.55	7,240,102.41

## § 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(%)	
中金公司	1	58,781,671.92	81.35	54,155.63	81.35	-
海通证券	1	13,478,500.97	18.65	12,418.06	18.65	-
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	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	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	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
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 1 个交易单元。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
中金公司	29,408.74	1.14	-	-	-	-
海通证券	48,832.00	1.90	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
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						
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券 (山东)	2,495,725.00	96.96	-	-	-	-

### 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
5	融通深证成份指数证券投资基金第四次分红公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 11 日
6	融通基金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
10	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
11	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
12	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
13	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
14	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
15	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
16	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	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 19 日

	其申购费率优惠活动的公告		
17	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
18	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
19	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
20	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深证成份指数证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通深证成份指数证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通深证成份指数证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通深证成份指数证券投资基金招募说明书》及其更新
- (五) 融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- (六) 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

#### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

#### 12.3 查阅方式

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

融通基金管理有限公司

2023 年 8 月 25 日