

融通深证成份指数证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：2024 年 8 月 29 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 2024 年 8 月 27 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 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	9
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
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51

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	51
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	52
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	52
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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	53
§ 9 开放式基金份额变动	54
§ 10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
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	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 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	88,872,740.30 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	79,411,608.63 份	9,461,131.67 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	深圳市南山区海德三道 1066 号深创投广场 41、42 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518054	100140
法定代表人	张威	廖林

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	深圳市南山区海德三道 1066 号深创投广场 41、42 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(2024年1月1日-2024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	-6,107,941.94	-782,865.94
本期利润	-3,341,465.03	-533,525.31
加权平均基金份额本期利润	-0.0431	-0.0539
本期加权平均净值利润率	-4.95%	-6.15%
本期基金份额净值增长率	-4.93%	-5.11%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利润	-12,031,822.06	-1,383,632.92
期末可供分配基金份额利润	-0.1515	-0.1462
期末基金资产净值	67,379,786.57	8,077,498.75
期末基金份额净值	0.848	0.854
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-9.32%	0.35%

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	-4.50%	0.77%	-5.23%	0.81%	0.73%	-0.04%
过去三个月	-4.07%	1.02%	-5.57%	1.06%	1.50%	-0.04%
过去六个月	-4.93%	1.29%	-6.70%	1.33%	1.77%	-0.04%
过去一年	-17.03%	1.11%	-18.78%	1.13%	1.75%	-0.02%
过去三年	-37.05%	1.17%	-39.86%	1.17%	2.81%	0.00%
自基金合同生效起至今	-9.32%	1.49%	-27.68%	1.45%	18.36%	0.04%

融通深证成份指数 C

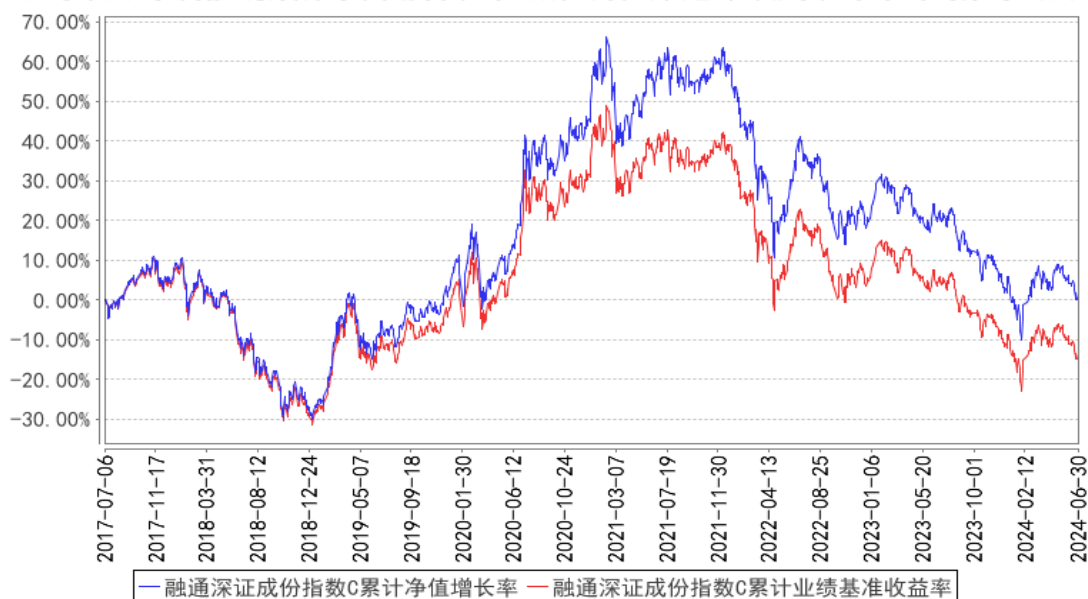
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-4.37%	0.77%	-5.23%	0.81%	0.86%	-0.04%
过去三个月	-4.04%	1.02%	-5.57%	1.06%	1.53%	-0.04%
过去六个月	-5.11%	1.30%	-6.70%	1.33%	1.59%	-0.03%
过去一年	-17.25%	1.12%	-18.78%	1.13%	1.53%	-0.01%
过去三年	-37.73%	1.17%	-39.86%	1.17%	2.13%	0.00%
自基金合同生效起至今	0.35%	1.32%	-14.71%	1.30%	15.06%	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，C 类份额首次确认日为 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、合格境内机构投资者资格（QDII）、保险资产受托管理资格、人民币合格境内机构投资者（RQDII）资格、合格境内投资企业（QDIE）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。

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	-	13年	蔡志伟先生，计算机应用技术硕士，金融风险管理师（FRM），13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、10 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 0.848 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.93%，同期业绩比较基准收益率为-6.70%；

截至本报告期末融通深证成份指数 C 基金份额净值为 0.854 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.11%，同期业绩比较基准收益率为-6.70%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾 2024 年上半年，全球经济缓慢复苏，全球制造业 PMI 恢复至荣枯线以上，新兴市场国家增速较快，中国制造业 PMI 也有所回升至 51.7。国内经济方面，2024 年上半年中国 GDP 增长 5%，持平全年 GDP 增长目标，经济总体平稳运行；其中一季度增长 5.3%，二季度增长 4.7%，较一季度有所回落，消费走弱以及基建房地产下行对经济增长形成拖累；总体而言，上半年国内宏观经济保持平稳增长，外需偏强而内需偏弱。A 股市场方面，上半年宽幅震荡，大盘指数较强，而个股较弱；从风格来看，小微盘股结束了 3 年的牛市，回调幅度较大；而红利、低估值类资产表现较好，市场风格分化显著。

展望下半年，随着美国通胀的缓解，美联储开启降息周期可期，有利于全球央行逐步进入降息的宽松周期，全球经济持续恢复。从国内经济来看，二季度经济增长有所放缓，但随着稳增长

政策以及房地产新政的持续发力，6 月基建和房地产投资增速开始反弹，预计下半年国内经济企稳回升，年内 5% 的经济增长目标大概率能完成。

A 股市场方面，从风格配置的角度看，大盘价值风格仍处于长期趋势上，预计红利类以及高 ROE 类资产仍将有所表现；而大盘成长风格有见底回归长周期向上的迹象，预计核心资产下半年将企稳回升；小盘股 1 月见本轮周期大顶，预计将迎来长周期的调整。从行业选择层面来看，出口链在经历调整后性价比已比较合适，优选对税收政策以及航运价格敏感性低的方向；数字经济是今明两年的主线，AI 为新一轮科技周期的重要方向，中长期具备战略配置属性；当前板块估值处于中枢，业绩持续超预期，逢低积极配置相关资产。而苹果链受益于首款苹果 AI 手机，预计在新品的拉动下仍将有所表现。重点关注 AI 的算力板块，包括光模块、AI 芯片以及苹果链等。

具体到本基金跟踪的深证成指数，是 A 股市场的核心市场指数，成分股高度集中于新经济方向，当前估值处于历史偏低水平。预计 2024 年下半年在经济、消费逐步复苏下，将有较好的投资机会。

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基金估值业务原则和程序管理细则》进行，公司设立由研究相关部门、风险管理部、登记清算部、稽核审计部和法律合规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。

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

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

本基金本报告期内未进行利润分配，符合法律法规和基金合同的规定。

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，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 2024 年度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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	2,227,156.64	3,997,608.67
结算备付金		86,687.48	14,736.35
存出保证金		1,863.86	2,679.04
交易性金融资产	6.4.7.2	73,408,436.78	73,184,949.09
其中：股票投资		70,862,960.75	71,134,790.26
基金投资		-	-
债券投资		2,545,476.03	2,050,158.83
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		1,925.63	54,620.78
应收股利		-	-
应收申购款		90,738.37	58,731.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		75,816,808.76	77,313,325.10
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		175,991.16	249,215.58
应付管理人报酬		63,212.78	63,936.78
应付托管费		12,642.56	12,787.36
应付销售服务费		2,651.04	2,997.59
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	105,025.90	130,845.32
负债合计		359,523.44	459,782.63
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	88,872,740.30	86,032,716.46
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-13,415,454.98	-9,179,173.99
净资产合计		75,457,285.32	76,853,542.47
负债和净资产总计		75,816,808.76	77,313,325.10

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 88,872,740.30 份，其中融通深证成份指数 A/B 类基金份额 79,411,608.63 份，基金份额净值 0.848 元，融通深证成份指数 C 类基金份额 9,461,131.67 份，基金份额净值 0.854 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 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
-----	-----	----	---------

		2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-3,346,311.93	1,781,096.58
1. 利息收入		5,850.17	6,251.55
其中：存款利息收入	6.4.7.13	5,850.17	6,251.55
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-6,396,449.17	683,105.25
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-7,376,056.13	-104,704.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	23,850.26	24,359.21
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
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	955,756.70	763,450.43
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	3,015,817.54	1,081,701.84
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	28,469.53	10,037.94
减：二、营业总支出		528,678.41	585,641.80
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	378,463.28	428,485.38
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	75,692.73	85,697.09
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	17,216.18	14,311.66
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	57,306.22	57,147.67
三、利润总额（亏损总额		-3,874,990.34	1,195,454.78

以“-”号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,874,990.34	1,195,454.78
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-3,874,990.34	1,195,454.78

6.3 净资产变动表

会计主体：融通深证成份指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	86,032,716.46	-	-9,179,173.99	76,853,542.47
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	86,032,716.46	-	-9,179,173.99	76,853,542.47
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,840,023.84	-	-4,236,280.99	-1,396,257.15
（一）、综合收益总额	-	-	-3,874,990.34	-3,874,990.34
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	2,840,023.84	-	-361,290.65	2,478,733.19
其中：1. 基金申购款	23,084,559.89	-	-3,043,348.07	20,041,211.82
2. 基金赎回款	-20,244,536.05	-	2,682,057.42	-17,562,478.63
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号	-	-	-	-

填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	88,872,740.30	-	-13,415,454.98	75,457,285.32
项目	上年度可比期间 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	82,968,964.88	-	956,290.28	83,925,255.16
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	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净资产变动数(净资产减少以“-”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净资产变动(净资产减少以“-”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	82,185,325.96	-	1,860,306.33	84,045,632.29

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>商小虎</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 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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	2,227,156.64
等于：本金	2,226,919.01
加：应计利息	237.63
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, 227, 156. 64
----	-----------------

6. 4. 7. 2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	81, 124, 671. 73	-	70, 862, 960. 75	-10, 261, 710. 98	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	2, 508, 600. 00	39, 226. 03	2, 545, 476. 03	-2, 350. 00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2, 508, 600. 00	39, 226. 03	2, 545, 476. 03	-2, 350. 00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	83, 633, 271. 73	39, 226. 03	73, 408, 436. 78	-10, 264, 060. 98	

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 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	121.47
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	47,718.21
其中：交易所市场	47,718.21
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	57,186.22
合计	105,025.90

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 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	75,196,472.26	75,196,472.26
本期申购	12,458,742.88	12,458,742.88
本期赎回（以“-”号填列）	-8,243,606.51	-8,243,606.51
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	79,411,608.63	79,411,608.63

融通深证成份指数 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	10,836,244.20	10,836,244.20
本期申购	10,625,817.01	10,625,817.01
本期赎回(以“-”号填列)	-12,000,929.54	-12,000,929.54
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	9,461,131.67	9,461,131.67

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	42,367,005.84	-50,458,477.15	-8,091,471.31
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	42,367,005.84	-50,458,477.15	-8,091,471.31
本期利润	-6,107,941.94	2,766,476.91	-3,341,465.03
本期基金份额交易产生的变动数	2,259,015.89	-2,857,901.61	-598,885.72
其中：基金申购款	6,704,618.07	-8,366,634.41	-1,662,016.34
基金赎回款	-4,445,602.18	5,508,732.80	1,063,130.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	38,518,079.79	-50,549,901.85	-12,031,822.06

融通深证成份指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,186,474.56	-2,274,177.24	-1,087,702.68
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-

本期期初	1,186,474.56	-2,274,177.24	-1,087,702.68
本期利润	-782,865.94	249,340.63	-533,525.31
本期基金份额交易产生的变动数	-129,569.18	367,164.25	237,595.07
其中：基金申购款	917,863.23	-2,299,194.96	-1,381,331.73
基金赎回款	-1,047,432.41	2,666,359.21	1,618,926.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	274,039.44	-1,657,672.36	-1,383,632.92

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入	5,614.73	
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	218.14	
其他	17.30	
合计	5,850.17	

注：此处其他列示的是基金交易保证金利息收入。

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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入	-7,376,056.13	
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	-7,376,056.13	

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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额	32,330,269.10	
减：卖出股票成本总额	39,621,723.69	
减：交易费用	84,601.54	
买卖股票差价收入	-7,376,056.13	

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 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	18,557.03
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	5,293.23
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	23,850.26

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,053,375.91
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,007,879.93
减：应计利息总额	40,202.23
减：交易费用	0.52
买卖债券差价收入	5,293.23

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	955,756.70
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	955,756.70

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	3,015,817.54
股票投资	3,021,787.54
债券投资	-5,970.00
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	3,015,817.54

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	27,582.80
基金转换费收入	886.73
合计	28,469.53

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. 基金的转换费用包括转换费和补差费，其中不低于转换费的 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 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	17,404.66
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
银行费用	120.00
合计	57,306.22

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、基金注册登记机构、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 2024年1月1日至2024 年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	378,463.28	428,485.38
其中：应支付销售机构的客户维护费	176,065.01	200,512.87
应支付基金管理人的净管理费	202,398.27	227,972.51

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 x1.00%/当年天数。

2. 客户维护费是基金管理人与基金销售机构约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的费用，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	75,692.73	85,697.09

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	73.55	73.55
中国工商银行	-	114.95	114.95
合计	-	188.50	188.50
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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
中国工商银行	-	-	-
合计	-	252.42	252.42

注：1. 本基金 A/B 类基金份额不收取销售服务费；

2. 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，按月支付给基金管理人，再由基金管理人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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	2,227,156.64	5,614.73	2,329,743.44	5,882.80

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，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

无。

6.4.12 期末（2024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
001359	平安电工	2024-03-19	1-6个月（含）	首发流通受限	17.39	20.60	50	869.50	1,030.00	-
001379	腾达科技	2024-01-11	1-6个月（含）	首发流通受限	16.98	13.48	53	899.94	714.44	-
001387	雪祺电气	2024-01-04	1-6个月（含）	首发流通受限	15.38	15.25	48	738.24	732.00	-
001387	雪祺电气	2024-06-03	1-6个月（含）	送股流通受限	-	15.25	14	-	213.50	-
001389	广合科技	2024-03-26	1-6个月（含）	首发流通受限	17.43	34.56	62	1,080.66	2,142.72	-
301392	汇成真空	2024-05-28	1-6个月（含）	首发流通受限	12.20	41.66	166	2,025.20	6,915.56	-
301502	华阳智能	2024-01-26	1-6个月（含）	首发流通受限	28.01	37.83	53	1,484.53	2,004.99	-

301536	星宸科技	2024-03-20	1-6 个月 (含)	首发流通受限	16.16	32.27	135	2,181.60	4,356.45	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	1-6 个月 (含)	首发流通受限	55.82	91.24	36	2,009.52	3,284.64	-
301538	骏鼎达	2024-05-22	1-6 个月 (含)	送股流通受限	-	91.24	14	-	1,277.36	-
301539	宏鑫科技	2024-04-03	1-6 个月 (含)	首发流通受限	10.64	19.82	179	1,904.56	3,547.78	-
301565	中仑新材	2024-06-13	1-6 个月 (含)	首发流通受限	11.88	18.98	170	2,019.60	3,226.60	-
301566	达利凯普	2023-12-22	1-6 个月 (含)	首发流通受限	8.90	16.97	199	1,771.10	3,377.03	-
301580	爱迪特	2024-06-19	1-6 个月 (含)	首发流通受限	44.95	65.93	45	2,022.75	2,966.85	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	1-6 个月 (含)	首发流通受限	21.73	25.26	92	1,999.16	2,323.92	-
301588	美新科技	2024-03-06	1-6 个月 (含)	首发流通受限	14.50	21.25	126	1,827.00	2,677.50	-
301591	肯特股份	2024-02-20	1-6 个月 (含)	首发流通受限	19.43	36.98	82	1,593.26	3,032.36	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

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

本基金是股票型基金，其预期收益及预期风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。本基金如果投资港股通标的股票，可能会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金投资

的金融工具主要包括股票投资等。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。本基金在严格控制风险并保持基金资产流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。

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。

监察稽核相关部门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 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00% (2023 年 12 月 31 日：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.01%)。

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	2,545,476.03	-
合计	2,545,476.03	-

注：1. 未评级债券为国债。

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

无。

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 2024 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 2024 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 2024 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未来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 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,227,156.64	-	-	-	2,227,156.64
结算备付金	86,687.48	-	-	-	86,687.48
存出保证金	1,863.86	-	-	-	1,863.86

交易性金融资产	2,545,476.03	-	-	-70,862,960.75	73,408,436.78
应收申购款	-	-	-	90,738.37	90,738.37
应收清算款	-	-	-	1,925.63	1,925.63
资产总计	4,861,184.01	-	-	-70,955,624.75	75,816,808.76
负债					
应付赎回款	-	-	-	175,991.16	175,991.16
应付管理人报酬	-	-	-	63,212.78	63,212.78
应付托管费	-	-	-	12,642.56	12,642.56
应付销售服务费	-	-	-	2,651.04	2,651.04
其他负债	-	-	-	105,025.90	105,025.90
负债总计	-	-	-	359,523.44	359,523.44
利率敏感度缺口	4,861,184.01	-	-	-70,596,101.31	75,457,285.32
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,997,608.67	-	-	-	3,997,608.67
结算备付金	14,736.35	-	-	-	14,736.35
存出保证金	2,679.04	-	-	-	2,679.04
交易性金融资产	2,038,858.08	-	11,300.75	71,134,790.26	73,184,949.09
应收申购款	-	-	-	58,731.17	58,731.17
应收清算款	-	-	-	54,620.78	54,620.78
资产总计	6,053,882.14	-	11,300.75	71,248,142.21	77,313,325.10
负债					
应付赎回款	-	-	-	249,215.58	249,215.58
应付管理人报酬	-	-	-	63,936.78	63,936.78
应付托管费	-	-	-	12,787.36	12,787.36
应付销售服务费	-	-	-	2,997.59	2,997.59
其他负债	-	-	-	130,845.32	130,845.32
负债总计	-	-	-	459,782.63	459,782.63
利率敏感度缺口	6,053,882.14	-	11,300.75	70,788,359.58	76,853,542.47

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 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为 3.37% (2023 年 12 月 31 日：2.67%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响 (2023 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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

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(ValueAtRisk) 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 2024年6月30日		上年度末 2023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	70,862,960.75	93.91	71,134,790.26	92.56
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	70,862,960.75	93.91	71,134,790.26	92.56

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除深证成份指数收益率以外的其他市场变量保持不变
----	-------------------------

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1. 深证成份指数收益率上升 5%	3,487,401.59	3,634,085.47
	2. 深证成份指数收益率下降 5%	-3,487,401.59	-3,634,085.47

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	70,819,137.05	70,947,377.58
第二层次	2,545,476.03	2,050,158.83
第三层次	43,823.70	187,412.68
合计	73,408,436.78	73,184,949.09

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证券，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证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，确定相关证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 2024 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（2023 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	70,862,960.75	93.47
	其中：股票	70,862,960.75	93.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,545,476.03	3.36
	其中：债券	2,545,476.03	3.36
	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	2,313,844.12	3.05
8	其他各项资产	94,527.86	0.12
9	合计	75,816,808.76	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	1,812,402.76	2.40
B	采矿业	1,319,526.38	1.75
C	制造业	54,546,895.11	72.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	901,549.00	1.19
E	建筑业	108,899.00	0.14
F	批发和零售业	624,630.99	0.83
G	交通运输、仓储和邮政业	1,066,589.00	1.41
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,155,704.95	4.18
J	金融业	4,717,953.19	6.25
K	房地产业	696,334.53	0.92
L	租赁和商务服务业	619,951.84	0.82

M	科学研究和技术服务业	305,375.50	0.40
N	水利、环境和公共设施管理业	166,557.00	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	62,424.00	0.08
Q	卫生和社会工作	413,074.80	0.55
R	文化、体育和娱乐业	301,269.00	0.40
S	综合	-	-
	合计	70,819,137.05	93.85

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	43,823.70	0.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
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	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	43,823.70	0.06

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	19,360	3,485,380.80	4.62
2	000333	美的集团	37,003	2,386,693.50	3.16
3	002475	立讯精密	46,957	1,845,879.67	2.45
4	000858	五粮液	13,546	1,734,429.84	2.30
5	002594	比亚迪	6,644	1,662,661.00	2.20

6	000651	格力电器	32,102	1,259,040.44	1.67
7	300760	迈瑞医疗	3,900	1,134,549.00	1.50
8	300308	中际旭创	7,188	991,081.44	1.31
9	300059	东方财富	93,369	985,976.64	1.31
10	002415	海康威视	31,735	980,928.85	1.30
11	000725	京东方 A	236,198	966,049.82	1.28
12	000568	泸州老窖	6,243	895,808.07	1.19
13	002714	牧原股份	18,775	818,590.00	1.08
14	300498	温氏股份	39,878	790,381.96	1.05
15	300274	阳光电源	12,644	784,307.32	1.04
16	300124	汇川技术	14,147	725,741.10	0.96
17	002371	北方华创	2,100	671,769.00	0.89
18	000063	中兴通讯	23,777	665,042.69	0.88
19	000001	平安银行	61,509	624,316.35	0.83
20	002352	顺丰控股	17,000	606,730.00	0.80
21	300502	新易盛	5,641	595,407.55	0.79
22	000338	潍柴动力	36,140	586,913.60	0.78
23	000100	TCL 科技	133,352	576,080.64	0.76
24	002142	宁波银行	25,323	558,625.38	0.74
25	000792	盐湖股份	27,500	479,875.00	0.64
26	002463	沪电股份	13,020	475,230.00	0.63
27	002230	科大讯飞	10,763	462,270.85	0.61
28	002027	分众传媒	73,964	448,221.84	0.59
29	000425	徐工机械	54,000	386,100.00	0.51
30	300014	亿纬锂能	9,278	370,377.76	0.49
31	002422	科伦药业	12,116	367,478.28	0.49
32	002304	洋河股份	4,535	366,155.90	0.49
33	000157	中联重科	46,341	355,898.88	0.47
34	002241	歌尔股份	17,914	349,502.14	0.46
35	000933	神火股份	16,800	339,864.00	0.45
36	300015	爱尔眼科	32,115	331,426.80	0.44
37	002001	新 和 成	17,245	331,104.00	0.44
38	000625	长安汽车	24,509	329,155.87	0.44
39	000002	万 科 A	46,400	321,552.00	0.43
40	002179	中航光电	8,257	314,178.85	0.42
41	002601	龙佰集团	16,900	313,833.00	0.42
42	300394	天孚通信	3,440	304,164.80	0.40
43	000786	北新建材	10,196	302,413.36	0.40
44	000938	紫光股份	13,375	298,931.25	0.40
45	000977	浪潮信息	8,064	293,287.68	0.39
46	002050	三花智控	15,283	291,599.64	0.39
47	002028	思源电气	4,300	287,670.00	0.38
48	002049	紫光国微	5,440	286,144.00	0.38

49	000538	云南白药	5,559	284,342.85	0.38
50	000166	申万宏源	65,820	283,684.20	0.38
51	300408	三环集团	9,350	272,926.50	0.36
52	002252	上海莱士	34,800	272,136.00	0.36
53	002311	海大集团	5,740	270,067.00	0.36
54	002532	天山铝业	32,800	266,008.00	0.35
55	300207	欣旺达	17,402	263,988.34	0.35
56	002273	水晶光电	15,500	263,190.00	0.35
57	000999	华润三九	6,120	260,589.60	0.35
58	002128	电投能源	12,300	259,530.00	0.34
59	300033	同花顺	2,500	259,250.00	0.34
60	000776	广发证券	21,260	258,734.20	0.34
61	000963	华东医药	9,300	258,633.00	0.34
62	300433	蓝思科技	14,060	256,595.00	0.34
63	002460	赣锋锂业	8,510	243,811.50	0.32
64	300122	智飞生物	8,600	241,058.00	0.32
65	000408	藏格矿业	10,000	240,700.00	0.32
66	300628	亿联网络	6,510	239,372.70	0.32
67	002008	大族激光	11,500	239,200.00	0.32
68	003816	中国广核	51,600	238,908.00	0.32
69	000683	远兴能源	33,800	233,558.00	0.31
70	000768	中航西飞	9,660	232,129.80	0.31
71	002648	卫星化学	12,886	231,690.28	0.31
72	002340	格林美	35,910	228,746.70	0.30
73	001979	招商蛇口	25,763	226,456.77	0.30
74	002493	荣盛石化	22,800	220,248.00	0.29
75	002236	大华股份	14,232	220,026.72	0.29
76	000596	古井贡酒	1,000	211,070.00	0.28
77	000661	长春高新	2,294	210,520.38	0.28
78	300782	卓胜微	2,704	210,208.96	0.28
79	002152	广电运通	19,875	207,892.50	0.28
80	000513	丽珠集团	5,558	206,813.18	0.27
81	000423	东阿阿胶	3,300	206,580.00	0.27
82	000807	云铝股份	15,200	205,352.00	0.27
83	300699	光威复材	8,241	204,624.03	0.27
84	000975	银泰黄金	12,472	203,168.88	0.27
85	000983	山西焦煤	19,400	200,014.00	0.27
86	002984	森麒麟	8,220	198,019.80	0.26
87	002064	华峰化学	27,500	197,175.00	0.26
88	000630	铜陵有色	54,200	195,662.00	0.26
89	002156	通富微电	8,700	194,793.00	0.26
90	002384	东山精密	9,350	193,545.00	0.26
91	002756	永兴材料	5,350	191,423.00	0.25

92	300661	圣邦股份	2,285	189,152.30	0.25
93	000895	双汇发展	7,817	185,810.09	0.25
94	000988	华工科技	6,200	185,566.00	0.25
95	300390	天华新能	10,800	185,544.00	0.25
96	002625	光启技术	10,500	182,175.00	0.24
97	300896	爱美客	1,040	178,984.00	0.24
98	002938	鹏鼎控股	4,500	178,920.00	0.24
99	002271	东方雨虹	14,443	178,226.62	0.24
100	002456	欧菲光	22,100	172,601.00	0.23
101	002736	国信证券	19,800	172,062.00	0.23
102	002745	木林森	21,200	170,872.00	0.23
103	300638	广和通	9,940	169,974.00	0.23
104	000581	威孚高科	10,300	167,684.00	0.22
105	002966	苏州银行	22,100	165,750.00	0.22
106	002223	鱼跃医疗	4,400	165,440.00	0.22
107	000400	许继电气	4,800	165,168.00	0.22
108	002078	太阳纸业	11,800	164,610.00	0.22
109	300832	新产业	2,400	161,856.00	0.21
110	002185	华天科技	19,734	160,832.10	0.21
111	300573	兴齐眼药	980	160,720.00	0.21
112	002709	天赐材料	9,052	158,953.12	0.21
113	002701	奥瑞金	38,020	158,163.20	0.21
114	002773	康弘药业	7,300	158,045.00	0.21
115	002459	晶澳科技	14,108	158,009.60	0.21
116	002353	杰瑞股份	4,451	156,141.08	0.21
117	002602	世纪华通	45,200	155,036.00	0.21
118	301236	软通动力	4,400	154,924.00	0.21
119	300482	万孚生物	6,180	150,792.00	0.20
120	002555	三七互娱	11,300	147,465.00	0.20
121	002600	领益智造	20,700	147,384.00	0.20
122	002916	深南电路	1,393	147,337.61	0.20
123	000559	万向钱潮	33,000	147,180.00	0.20
124	002048	宁波华翔	11,300	146,222.00	0.19
125	300476	胜宏科技	4,500	145,170.00	0.19
126	002465	海格通信	13,930	144,314.80	0.19
127	002797	第一创业	27,920	142,112.80	0.19
128	002138	顺络电子	5,100	140,046.00	0.19
129	300003	乐普医疗	9,300	138,012.00	0.18
130	002563	森马服饰	23,700	137,697.00	0.18
131	000066	中国长城	15,728	137,620.00	0.18
132	000878	云南铜业	10,900	135,814.00	0.18
133	002281	光迅科技	3,600	134,532.00	0.18
134	300726	宏达电子	5,900	134,520.00	0.18

135	301219	腾远钴业	3,500	133,910.00	0.18
136	000932	华菱钢铁	30,080	133,254.40	0.18
137	000582	北部湾港	17,900	133,176.00	0.18
138	002202	金风科技	19,788	132,975.36	0.18
139	002409	雅克科技	2,100	132,111.00	0.18
140	300316	晶盛机电	4,520	129,859.60	0.17
141	001965	招商公路	10,900	129,274.00	0.17
142	000733	振华科技	3,100	128,743.00	0.17
143	002517	恺英网络	13,400	127,970.00	0.17
144	300496	中科创达	2,800	127,652.00	0.17
145	300450	先导智能	7,641	127,069.83	0.17
146	300017	网宿科技	16,000	126,400.00	0.17
147	002444	巨星科技	5,100	125,970.00	0.17
148	002466	天齐锂业	4,200	125,622.00	0.17
149	000039	中集集团	13,550	125,473.00	0.17
150	000426	兴业银锡	9,200	124,936.00	0.17
151	002812	恩捷股份	3,900	123,435.00	0.16
152	300136	信维通信	6,295	123,256.10	0.16
153	002978	安宁股份	4,400	122,584.00	0.16
154	002007	华兰生物	7,685	121,346.15	0.16
155	000728	国元证券	19,990	121,139.40	0.16
156	002738	中矿资源	4,500	120,600.00	0.16
157	300474	景嘉微	1,900	120,137.00	0.16
158	000528	柳 工	10,500	117,495.00	0.16
159	000021	深科技	7,700	116,424.00	0.15
160	002673	西部证券	18,748	116,050.12	0.15
161	300999	金龙鱼	4,242	116,018.70	0.15
162	300054	鼎龙股份	5,100	115,668.00	0.15
163	002595	豪迈科技	3,000	114,510.00	0.15
164	300002	神州泰岳	14,100	114,492.00	0.15
165	002739	万达电影	9,300	112,437.00	0.15
166	000960	锡业股份	7,200	111,528.00	0.15
167	300866	安克创新	1,560	111,087.60	0.15
168	002155	湖南黄金	6,045	109,414.50	0.15
169	300001	特锐德	5,400	108,648.00	0.14
170	000783	长江证券	22,325	107,829.75	0.14
171	300012	华测检测	10,600	106,636.00	0.14
172	002821	凯莱英	1,620	106,596.00	0.14
173	002405	四维图新	17,000	105,740.00	0.14
174	002472	双环传动	4,800	105,696.00	0.14
175	002318	久立特材	4,500	104,985.00	0.14
176	000617	中油资本	18,900	104,328.00	0.14
177	300285	国瓷材料	5,800	103,530.00	0.14

178	000703	恒逸石化	14,600	103,514.00	0.14
179	300073	当升科技	3,000	102,930.00	0.14
180	000009	中国宝安	11,900	102,340.00	0.14
181	300037	新宙邦	3,580	102,244.80	0.14
182	301269	华大九天	1,300	100,165.00	0.13
183	002410	广联达	10,400	99,632.00	0.13
184	000738	航发控制	4,951	99,366.57	0.13
185	002850	科达利	1,300	99,294.00	0.13
186	002195	岩山科技	39,400	98,894.00	0.13
187	002025	航天电器	2,121	98,371.98	0.13
188	002407	多氟多	8,020	98,084.60	0.13
189	301358	湖南裕能	3,100	97,526.00	0.13
190	300724	捷佳伟创	1,800	97,218.00	0.13
191	300144	宋城演艺	12,100	97,163.00	0.13
192	002176	江特电机	11,900	96,985.00	0.13
193	000591	太阳能	20,500	96,555.00	0.13
194	300919	中伟股份	3,080	95,449.20	0.13
195	300395	菲利华	3,100	95,325.00	0.13
196	300114	中航电测	2,100	95,025.00	0.13
197	002262	恩华药业	4,000	94,960.00	0.13
198	000921	海信家电	2,900	93,496.00	0.12
199	000403	派林生物	3,500	93,310.00	0.12
200	002294	信立泰	3,500	93,205.00	0.12
201	300413	芒果超媒	4,440	92,796.00	0.12
202	300251	光线传媒	10,900	91,669.00	0.12
203	300418	昆仑万维	2,800	90,272.00	0.12
204	000623	吉林敖东	6,700	89,780.00	0.12
205	002439	启明星辰	5,200	89,752.00	0.12
206	002385	大北农	23,250	89,512.50	0.12
207	000519	中兵红箭	6,100	89,487.00	0.12
208	002129	TCL 中环	10,200	88,230.00	0.12
209	300024	机器人	9,000	87,660.00	0.12
210	300529	健帆生物	3,210	87,344.10	0.12
211	000830	鲁西化工	7,500	86,925.00	0.12
212	300118	东方日升	7,100	85,910.00	0.11
213	002558	巨人网络	9,100	85,904.00	0.11
214	300383	光环新网	10,100	85,345.00	0.11
215	300347	泰格医药	1,750	85,050.00	0.11
216	300604	长川科技	3,100	84,227.00	0.11
217	000708	中信特钢	6,170	83,726.90	0.11
218	300677	英科医疗	3,100	83,111.00	0.11
219	002958	青农商行	30,900	82,812.00	0.11
220	000875	吉电股份	15,400	82,082.00	0.11

221	300373	扬杰科技	2,100	81,690.00	0.11
222	002044	美年健康	21,600	81,648.00	0.11
223	000034	神州数码	3,500	80,115.00	0.11
224	002841	视源股份	2,700	79,731.00	0.11
225	300775	三角防务	2,600	79,560.00	0.11
226	000060	中金岭南	18,500	78,440.00	0.10
227	300253	卫宁健康	13,285	78,381.50	0.10
228	300568	星源材质	9,491	77,826.20	0.10
229	002056	横店东磁	6,200	77,314.00	0.10
230	002429	兆驰股份	16,000	76,960.00	0.10
231	000998	隆平高科	7,800	76,674.00	0.10
232	300442	润泽科技	3,200	76,640.00	0.10
233	002120	韵达股份	9,900	76,626.00	0.10
234	002180	纳思达	2,900	76,618.00	0.10
235	000997	新大陆	5,500	76,505.00	0.10
236	300679	电连技术	1,900	76,437.00	0.10
237	300294	博雅生物	2,300	75,900.00	0.10
238	000883	湖北能源	12,600	75,726.00	0.10
239	002430	杭氧股份	3,400	75,650.00	0.10
240	002624	完美世界	9,900	75,240.00	0.10
241	300458	全志科技	3,200	75,232.00	0.10
242	002508	老板电器	3,400	75,140.00	0.10
243	300601	康泰生物	4,700	73,367.00	0.10
244	000636	风华高科	5,600	73,136.00	0.10
245	300979	华利集团	1,200	73,020.00	0.10
246	002151	北斗星通	3,000	72,540.00	0.10
247	000887	中鼎股份	5,900	72,216.00	0.10
248	300296	利亚德	16,000	72,000.00	0.10
249	300088	长信科技	15,300	71,910.00	0.10
250	002065	东华软件	15,900	71,868.00	0.10
251	002936	郑州银行	41,500	71,795.00	0.10
252	002414	高德红外	12,100	71,269.00	0.09
253	300009	安科生物	8,316	71,018.64	0.09
254	002372	伟星新材	4,600	70,932.00	0.09
255	000690	宝新能源	13,800	70,380.00	0.09
256	300459	汤姆猫	20,700	70,173.00	0.09
257	000598	兴蓉环境	9,300	69,936.00	0.09
258	002368	太极股份	3,100	69,905.00	0.09
259	002851	麦格米特	2,700	69,768.00	0.09
260	002831	裕同科技	2,700	69,093.00	0.09
261	000027	深圳能源	9,400	68,620.00	0.09
262	002568	百润股份	4,052	68,195.16	0.09
263	300115	长盈精密	5,679	68,091.21	0.09

264	001286	陕西能源	5,900	68,027.00	0.09
265	002203	海亮股份	8,500	67,830.00	0.09
266	002507	涪陵榨菜	5,520	67,620.00	0.09
267	002939	长城证券	10,000	67,000.00	0.09
268	002389	航天彩虹	4,800	66,672.00	0.09
269	300666	江丰电子	1,400	66,584.00	0.09
270	002080	中材科技	5,160	66,564.00	0.09
271	301308	江波龙	700	66,318.00	0.09
272	002500	山西证券	14,100	66,270.00	0.09
273	000893	亚钾国际	4,100	66,256.00	0.09
274	300803	指南针	1,800	65,538.00	0.09
275	002683	广东宏大	3,200	64,416.00	0.09
276	002019	亿帆医药	5,200	64,272.00	0.09
277	002487	大金重工	2,800	64,064.00	0.08
278	000778	新兴铸管	18,400	64,032.00	0.08
279	002131	利欧股份	44,500	63,635.00	0.08
280	000155	川能动力	5,900	63,543.00	0.08
281	000951	中国重汽	4,420	63,294.40	0.08
282	002402	和而泰	5,900	63,189.00	0.08
283	000422	湖北宜化	5,300	63,176.00	0.08
284	002557	洽洽食品	2,241	63,173.79	0.08
285	002572	索菲亚	4,100	62,853.00	0.08
286	300070	碧水源	15,000	62,850.00	0.08
287	002607	中公教育	40,800	62,424.00	0.08
288	000050	深天马 A	8,500	61,880.00	0.08
289	300558	贝达药业	1,900	61,845.00	0.08
290	301301	川宁生物	4,800	61,344.00	0.08
291	000563	陕国投 A	22,200	61,050.00	0.08
292	002920	德赛西威	700	60,963.00	0.08
293	002531	天顺风能	6,800	60,792.00	0.08
294	300212	易华录	3,600	60,588.00	0.08
295	002832	比音勒芬	2,500	60,425.00	0.08
296	000686	东北证券	10,800	60,264.00	0.08
297	002244	滨江集团	8,300	60,258.00	0.08
298	002299	圣农发展	4,400	60,016.00	0.08
299	002221	东华能源	7,300	59,933.00	0.08
300	300676	华大基因	1,700	59,517.00	0.08
301	002653	海思科	1,900	58,330.00	0.08
302	300672	国科微	1,100	58,124.00	0.08
303	000547	航天发展	9,900	58,014.00	0.08
304	000709	河钢股份	29,900	58,006.00	0.08
305	300595	欧普康视	3,680	57,702.40	0.08
306	002249	大洋电机	12,100	57,233.00	0.08

307	000069	华侨城 A	27,944	57,005.76	0.08
308	000739	普洛药业	4,200	56,994.00	0.08
309	300229	拓尔思	4,200	56,406.00	0.07
310	000762	西藏矿业	3,100	56,048.00	0.07
311	300777	中简科技	2,600	55,900.00	0.07
312	000035	中国天楹	12,300	55,719.00	0.07
313	000825	太钢不锈	16,300	55,094.00	0.07
314	000902	新洋丰	4,600	54,602.00	0.07
315	300034	钢研高纳	3,400	54,026.00	0.07
316	002698	博实股份	4,400	53,988.00	0.07
317	300623	捷捷微电	3,100	53,630.00	0.07
318	000937	冀中能源	8,000	53,600.00	0.07
319	002617	露笑科技	11,100	53,280.00	0.07
320	002245	蔚蓝锂芯	6,800	52,700.00	0.07
321	000012	南玻 A	10,300	51,912.00	0.07
322	001227	兰州银行	21,700	51,646.00	0.07
323	002237	恒邦股份	4,400	50,644.00	0.07
324	002408	齐翔腾达	9,000	50,400.00	0.07
325	002484	江海股份	3,800	50,350.00	0.07
326	002032	苏泊尔	1,000	50,100.00	0.07
327	002597	金禾实业	2,500	49,725.00	0.07
328	002948	青岛银行	14,400	48,528.00	0.06
329	300457	赢合科技	2,700	48,141.00	0.06
330	300910	瑞丰新材	1,100	48,092.00	0.06
331	002266	浙富控股	17,200	47,988.00	0.06
332	300748	金力永磁	3,700	47,952.00	0.06
333	000032	深桑达 A	3,200	47,936.00	0.06
334	002541	鸿路钢构	2,800	47,516.00	0.06
335	300773	拉卡拉	3,800	47,234.00	0.06
336	300026	红日药业	15,400	46,970.00	0.06
337	300776	帝尔激光	1,000	45,960.00	0.06
338	002074	国轩高科	2,400	45,960.00	0.06
339	300761	立华股份	2,020	45,732.80	0.06
340	000555	神州信息	4,900	45,668.00	0.06
341	300674	宇信科技	4,120	45,649.60	0.06
342	002091	江苏国泰	6,600	44,946.00	0.06
343	000800	一汽解放	5,700	44,631.00	0.06
344	300769	德方纳米	1,576	44,443.20	0.06
345	000876	新希望	4,800	43,872.00	0.06
346	301050	雷电微力	900	43,344.00	0.06
347	002906	华阳集团	1,600	42,816.00	0.06
348	000028	国药一致	1,313	42,317.99	0.06
349	002396	星网锐捷	3,200	42,272.00	0.06

350	002865	钧达股份	1,100	42,218.00	0.06
351	000987	越秀资本	8,500	42,160.00	0.06
352	002643	万润股份	4,100	41,000.00	0.05
353	000089	深圳机场	6,400	40,896.00	0.05
354	300747	锐科激光	2,300	40,825.00	0.05
355	000156	华数传媒	6,500	40,820.00	0.05
356	002727	一心堂	2,700	40,743.00	0.05
357	002867	周大生	3,100	40,486.00	0.05
358	300357	我武生物	2,000	40,440.00	0.05
359	002690	美亚光电	2,340	38,610.00	0.05
360	002212	天融信	7,900	38,473.00	0.05
361	002326	永太科技	4,900	38,318.00	0.05
362	000301	东方盛虹	4,800	38,256.00	0.05
363	000785	居然之家	15,700	38,151.00	0.05
364	301039	中集车辆	4,400	37,840.00	0.05
365	300682	朗新集团	4,400	37,444.00	0.05
366	002183	怡亚通	13,000	36,920.00	0.05
367	002099	海翔药业	7,200	36,792.00	0.05
368	002254	泰和新材	4,100	36,285.00	0.05
369	002670	国盛金控	4,200	35,574.00	0.05
370	000967	盈峰环境	8,200	34,686.00	0.05
371	300171	东富龙	2,900	34,481.00	0.05
372	000810	创维数字	4,000	34,320.00	0.05
373	300432	富临精工	5,300	34,132.00	0.05
374	002608	江苏国信	4,400	34,100.00	0.05
375	000958	电投产融	9,200	33,672.00	0.04
376	300751	迈为股份	279	33,334.92	0.04
377	002010	传化智联	8,600	33,024.00	0.04
378	001872	招商港口	1,700	32,725.00	0.04
379	000930	中粮科技	6,400	32,192.00	0.04
380	001287	中电港	1,900	31,407.00	0.04
381	002081	金螳螂	10,300	31,209.00	0.04
382	301035	润丰股份	700	31,178.00	0.04
383	001914	招商积余	3,100	31,062.00	0.04
384	000401	冀东水泥	7,600	30,856.00	0.04
385	300376	ST 易事特	7,600	30,476.00	0.04
386	300759	康龙化成	1,625	30,192.50	0.04
387	002060	广东建工	8,700	29,754.00	0.04
388	002705	新宝股份	2,100	29,547.00	0.04
389	001203	大中矿业	3,000	28,830.00	0.04
390	002498	汉缆股份	8,700	28,623.00	0.04
391	300142	沃森生物	2,500	28,450.00	0.04
392	002518	科士达	1,600	28,320.00	0.04

393	300428	立中集团	1,500	27,885.00	0.04
394	300257	开山股份	2,700	27,270.00	0.04
395	002216	三全食品	2,400	26,352.00	0.03
396	000959	首钢股份	9,600	26,112.00	0.03
397	301029	怡合达	1,300	25,558.00	0.03
398	002320	海峡股份	4,700	24,252.00	0.03
399	301155	海力风电	600	24,138.00	0.03
400	301047	义翘神州	400	23,980.00	0.03
401	000627	天茂集团	13,400	23,450.00	0.03
402	300861	美畅股份	1,200	23,220.00	0.03
403	001213	中铁特货	5,800	22,910.00	0.03
404	002925	盈趣科技	1,770	22,425.90	0.03
405	002110	三钢闽光	7,600	22,420.00	0.03
406	002041	登海种业	2,600	21,008.00	0.03
407	002945	华林证券	2,100	20,958.00	0.03
408	000062	深圳华强	2,300	20,470.00	0.03
409	000935	四川双马	1,700	20,417.00	0.03
410	000831	中国稀土	800	20,280.00	0.03
411	301207	华兰疫苗	1,100	19,437.00	0.03
412	002461	珠江啤酒	2,600	19,292.00	0.03
413	000567	海德股份	3,335	18,709.35	0.02
414	301165	锐捷网络	600	17,904.00	0.02
415	300821	东岳硅材	2,500	17,100.00	0.02
416	002085	万丰奥威	1,200	15,888.00	0.02
417	001308	康冠科技	600	13,500.00	0.02
418	002901	大博医疗	500	12,915.00	0.02
419	300223	北京君正	200	11,088.00	0.01
420	002436	兴森科技	700	7,224.00	0.01
421	300487	蓝晓科技	150	6,264.00	0.01
422	301177	迪阿股份	300	5,580.00	0.01
423	300765	新诺威	160	4,036.80	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	301392	汇成真空	166	6,915.56	0.01
2	301538	骏鼎达	50	4,562.00	0.01
3	301536	星辰科技	135	4,356.45	0.01
4	301539	宏鑫科技	179	3,547.78	0.00
5	301566	达利凯普	199	3,377.03	0.00
6	301565	中仑新材	170	3,226.60	0.00
7	301591	肯特股份	82	3,032.36	0.00
8	301580	爱迪特	45	2,966.85	0.00
9	301588	美新科技	126	2,677.50	0.00

10	301587	中瑞股份	92	2,323.92	0.00
11	001389	广合科技	62	2,142.72	0.00
12	301502	华阳智能	53	2,004.99	0.00
13	001359	平安电工	50	1,030.00	0.00
14	001387	雪祺电气	62	945.50	0.00
15	001379	腾达科技	53	714.44	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	002475	立讯精密	872,071.00	1.13
2	000333	美的集团	451,081.00	0.59
3	300750	宁德时代	436,892.00	0.57
4	300316	晶盛机电	332,059.00	0.43
5	300394	天孚通信	319,704.00	0.42
6	300782	卓胜微	291,733.00	0.38
7	000651	格力电器	288,789.00	0.38
8	000568	泸州老窖	281,567.00	0.37
9	002563	森马服饰	260,333.00	0.34
10	300638	广和通	258,968.00	0.34
11	300274	阳光电源	258,096.00	0.34
12	000963	华东医药	257,762.00	0.34
13	301269	华大九天	254,911.00	0.33
14	002978	安宁股份	242,137.00	0.32
15	000858	五粮液	241,576.00	0.31
16	002142	宁波银行	241,092.00	0.31
17	300015	爱尔眼科	239,891.00	0.31
18	300122	智飞生物	229,707.00	0.30
19	002920	德赛西威	227,482.00	0.30
20	002594	比亚迪	218,738.00	0.28

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	002920	德赛西威	345,414.00	0.45
2	002475	立讯精密	341,161.00	0.44
3	000651	格力电器	322,091.00	0.42
4	000333	美的集团	314,567.00	0.41
5	300316	晶盛机电	302,611.00	0.39
6	300750	宁德时代	250,764.00	0.33

7	300782	卓胜微	244,800.00	0.32
8	300015	爱尔眼科	244,224.00	0.32
9	002074	国轩高科	220,316.00	0.29
10	002142	宁波银行	219,021.00	0.28
11	000858	五粮液	213,418.00	0.28
12	300498	温氏股份	213,294.00	0.28
13	002085	万丰奥威	203,705.00	0.27
14	300496	中科创达	202,945.00	0.26
15	002050	三花智控	194,425.00	0.25
16	300073	当升科技	193,414.00	0.25
17	002371	北方华创	190,843.00	0.25
18	000921	海信家电	190,229.00	0.25
19	002373	千方科技	186,957.00	0.24
20	300957	贝泰妮	185,450.00	0.24

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	36,328,106.64
卖出股票收入（成交）总额	32,330,269.10

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	2,545,476.03	3.37
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,545,476.03	3.37

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	019727	23 国债 24	25,000	2,545,476.03	3.37

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	1,863.86
2	应收清算款	1,925.63
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	90,738.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	94,527.86

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	301392	汇成真空	6,915.56	0.01	首发流通受限
2	301538	骏鼎达	4,562.00	0.01	首发流通受限
3	301536	星辰科技	4,356.45	0.01	首发流通受限
4	301539	宏鑫科技	3,547.78	0.00	首发流通受限
5	301566	达利凯普	3,377.03	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 (%)
融通深证成份指数 A/B	5,391	14,730.40	-	-	79,411,608.63	100.00
融通深证成份指数 C	1,916	4,937.96	117,375.88	1.24	9,343,755.79	98.76
合计	7,307	12,162.69	117,375.88	0.13	88,755,364.42	99.87

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	50,182.67	0.06319
	融通深证成份指数 C	58.80	0.00062
	合计	50,241.47	0.05653

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	融通深证成份指数 A/B	0

金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	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	75,196,472.26	10,836,244.20
本报告期基金总申购份额	12,458,742.88	10,625,817.01
减：本报告期基金总赎回份额	8,243,606.51	12,000,929.54
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	79,411,608.63	9,461,131.67

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

1、2024 年 1 月 27 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》，新任张民为公司副总经理，上述变更事项经本公司董事会审议通过。

2、2024 年 4 月 23 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》，公司副总经理商小虎代任公司总经理，张帆不再担任公司总经理，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），该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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，本基金的托管人的托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中泰证券	3	29,909,597.69	43.71	27,991.98	43.71	-
华泰证券	1	21,181,304.74	30.95	19,823.75	30.95	-
中金公司	1	17,342,360.14	25.34	16,231.10	25.34	-
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	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	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	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

(山东)						
------	--	--	--	--	--	--

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五个方面：

- 1) 实力雄厚，信誉良好；内部管理规范，严格；注册资本符合证监会相关要求；
- 2) 研究实力较强，有稳定的研究机构和专业的研究人员，能及时为本公司提供高质量的研究支持与服务，包括宏观与策略报告、行业与公司分析报告、债券市场分析报告和金融衍生品分析报告等，并能根据基金投资的特定需求，提供专门研究报告；
- 3) 券商利用其他专业研究咨询机构为本公司提供研究与支持服务的，对该券商研究方面的要求按照上述第 2 点规定执行；
- 4) 严格禁止将席位开设与券商的基金销售挂钩；
- 5) 严格禁止向券商承诺基金在交易单元上的交易量。

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) 评价券商。投资研究相关部门对拟合作券商的研究质量与研究服务进行评价；
- 2) 拟定合作券商。投资研究相关部门根据券商选择标准，拟定备选合作券商；
- 3) 上报批准。投资研究相关部门将备选合作券商上报至研究部，由研究部将备选合作券商的情况上报公司批准；
- 4) 签署协议。在获得批准后，研究部依据公司合同审批流程，与确定的券商签约。

3、交易单元变更情况

本报告期内，退租中泰证券 1 个交易单元。

4、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》的要求，本公司已于法规规定的时间内，完成调整相关交易费用。

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 (%)
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	13,175.91	0.52	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-

东方财富	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
野村东方证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券（山东）	2,508,600.00	99.48	-	-	-	-

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	2024年1月26日
2	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	2024年1月27日
3	关于旗下部分开放式基金新增麦高证券有限责任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	2024年3月11日
4	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增中信银行股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务、转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月19日
5	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增上海大智慧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	2024年4月18日
6	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	2024年4月23日
7	关于旗下部分开放式基金新增中信建投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	2024年4月30日
8	关于旗下部分开放式基金新增江海证券有限公司为	中国证监会指	2024年6月4日

	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	定报刊及网站	
9	融通基金管理有限公司关于公司办公地址变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 15 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

2024 年 8 月 29 日