

融通中证军工指数分级证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2016 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。本半年度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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据融通中证军工指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同规定，于 2016 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
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	11
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	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	14
§ 7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	31
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	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	35
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	36
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	36
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	36
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	36
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	36
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	36
7.12 投资组合报告附注	36

§ 8 基金份额持有人信息	37
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	37
8.2 期末上市基金前十名持有人	37
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	38
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	39
§ 9 开放式基金份额变动	39
§ 10 重大事件揭示	39
10.1 基金份额持有人大会决议	39
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	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	40
10.4 基金投资策略的改变	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	40
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	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	40
10.8 其他重大事件	42
§ 11 备查文件目录	43

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	融通中证军工指数分级证券投资基金		
基金简称	融通军工分级		
场内简称	融通军工		
基金主代码	161628		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 7 月 1 日		
基金管理人	融通基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	336,746,140.97 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2015 年 7 月 13 日		
下属分级基金的基金简称	融通军工分级	军工股 A	军工股 B
下属分级基金的场内简称	融通中证军工	军工股 A	军工股 B
下属分级基金的交易代码	161628	150335	150336
报告期末下属分级基金份额总额	91,469,488.97 份	122,638,326.00 份	122,638,326.00 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证军工指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。		
投资策略	本基金采用完全复制法进行投资，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动对投资组合进行相应调整。		
业绩比较基准	95%×中证军工价格指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率（税后）。		
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看，融通军工 A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征；融通军工 B 份额具有高预期风险、预期收益相对较高的特征。		
下属分级基金的风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征。	融通军工股 A 份额为稳健收益类份额，具有低预期风险、预期收益相对稳定的风险收益特征。	融通军工股 B 份额为积极收益类份额，具有高预期风险、预期收益相对较高的风险收益特征。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	涂卫东	田青
	联系电话	(0755) 26948666	(010) 67595096
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	tianqingl.zh@ccb.com

客户服务电话	400-883-8088、(0755) 26948088	(010) 67595096
传真	(0755) 26935005	(010) 66275853
注册地址	深圳市南山区华侨城汉唐 大厦 13、14 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	深圳市南山区华侨城汉唐 大厦 13、14 层	北京市西城区闹市口大街 1 号 院 1 号楼
邮政编码	518053	100033
法定代表人	高峰	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处、深圳证券交易所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-20,511,485.04
本期利润	-38,866,675.81
加权平均基金份额本期利润	-0.1230
本期加权平均净值利润率	-15.17%
本期基金份额净值增长率	-18.91%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-47,683,066.19
期末可供分配基金份额利润	-0.1416
期末基金资产净值	284,673,881.98
期末基金份额净值	0.845
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-14.38%

注：(1) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

(2) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

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

的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

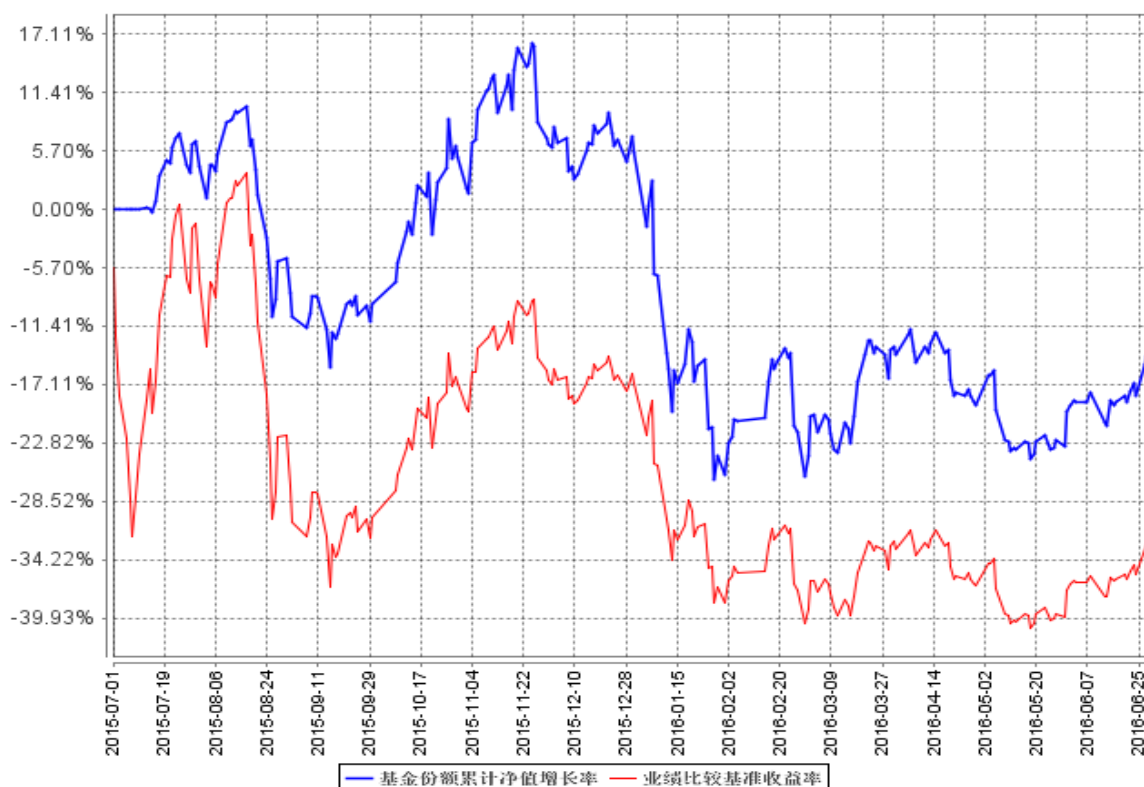
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	6.69%	1.53%	7.37%	1.42%	-0.68%	0.11%
过去三个月	-1.17%	1.69%	-0.25%	1.66%	-0.92%	0.03%
过去六个月	-18.91%	2.73%	-18.88%	2.46%	-0.03%	0.27%
自基金合同生效起至今	-14.38%	2.45%	-32.64%	3.18%	18.26%	-0.73%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同生效日为 2015 年 7 月 1 日。

2、本基金的建仓期为自合同生效日起 6 个月,截止建仓期结束,各项资产配置比例符合规定。”

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

融通基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证监会证监基字[2001]8号文批准，于2001年5月22日成立，公司注册资本12500万元人民币。本公司的股东及其出资比例为：新时代证券股份有限公司60%、日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co., Ltd.）40%。

截至2016年6月30日，公司管理的基金共有四十五只：一只封闭式基金，即融通通乾封闭式基金；四十四只开放式基金，即融通新蓝筹混合基金、融通债券基金、融通深证100指数基金、融通蓝筹成长混合基金、融通行业景气混合基金、融通巨潮100指数基金（LOF）、融通易支付货币基金、融通动力先锋股票基金、融通领先成长混合基金（LOF）、融通内需驱动混合基金、融通深证成份指数基金、融通四季添利债券基金、融通创业板指数基金、融通医疗保健混合基金、融通岁岁添利定期开放债券基金、融通丰利四分法（QDII-FOF）基金、融通汇财宝货币市场基金、融通标普中国可转债指数增强基金、融通通泰保本混合基金、融通通泽混合基金、融通通福分级债券基金、融通通源短融债券基金、融通通瑞债券基金、融通月月添利基金、融通健康产业混合基金、融通转型三动力混合基金、融通互联网传媒混合基金、融通新区域新经济混合基金、融通通鑫混合基金、融通新能源混合基金、融通军工分级指数基金、融通证券分级指数基金、融通农业分级指数基金、融通跨界成长混合基金、融通新机遇混合基金、融通成长30混合基金、融通中国风1号混合基金、融通通盈保本混合基金、融通增利债券基金、融通增裕债券基金、融通增鑫债券基金、融通增益债券基金、融通增祥债券基金和融通新消费混合基金。其中，融通债券基金、融通深证100指数基金和融通蓝筹成长混合基金同属融通通利系列证券投资基金。此外，公司还开展了特定客户资产管理业务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何天翔	融通深证100指数证券投资基金、融通中证军工指数分级证券投资基金、	2015年7月1日	-	8	何天翔先生，厦门大学经济学硕士、安徽大学理学学士，8年证券投资从业经历，具有基金从业资格。曾就职于华泰联合证券有限公司任金融工程分析师。2010年3月加入融通基金管理有限公司，历任

	融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金、融通中证大农业指数分级证券投资基金的基金经理			金融工程研究员、专户投资投资经理，2014 年 10 月 25 日起至今任“融通深证 100 指数证券投资基金”基金经理，2015 年 7 月 1 日起至今任“融通中证军工指数分级证券投资基金”基金经理，2015 年 7 月 17 日起至今任“融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金”基金经理，2015 年 8 月 25 日起至今任“融通中证大农业指数分级证券投资基金”基金经理。
--	---	--	--	---

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为-18.91%，同期业绩比较基准收益率-18.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年我国整体宏观经济运行平稳，二季度部分经济指标出现回落，包括民间投资、下游消费等，反映国内中长期仍处在“三期叠加”阶段。展望下半年，宏观经济有望延续平稳增长，PPI 在大宗价格阶段回暖下降幅持续收窄，CPI 在生猪存量回升、蔬菜季节性消除后将维持在较低水平，同时外围国际环境不确定性增加，英国退欧谈判、美联储加息的反复以及周边军事动荡都会对国内带来一定影响，但国内促改革、稳增长的政策基调仍将延续，货币政策将保持松紧适度、灵活调整，财政政策有望继续加码。证券市场方面，经过二季度外围不确定带来的动荡，在改革预期升温、流动性边际改善的整体环境下，下半年市场行情值得期待，大盘估值或将仍处中等偏低水平，具备较好的长期价值。板块结构方面，看好改革受益、创新驱动、业绩稳定的行业和板块。军工行业在国企改革深入、军民融合政策加码、地缘关系变化的大背景下，将可能会有较好的表现机会和弹性空间，本基金为参与军工投资的投资者提供一个指数化的工具。

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、参考独立第三方机构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，估值委员会成员不包含基金经理。

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计算每日基金净值，每日对基金所投资品种的公开信息、基金会计估值方法的法规等进行搜集并整理汇总，供估值委员会参考，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。基金经理不参与估值决定，参与估值流程各方之间亦不存在任何重大利益冲突，截至报告期末公司未与外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同约定，本基金（包括：融通中证军工份额、军工股 A 份额、军工股 B 份额）不进行收益分配。

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

无。

§ 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 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：融通中证军工指数分级证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	19,912,890.06	24,712,504.27
结算备付金		438,098.24	135,195.31
存出保证金		139,217.20	57,658.46
交易性金融资产	6.4.7.2	269,329,740.43	219,029,263.78
其中: 股票投资		269,329,740.43	219,029,263.78
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,903,711.44	-
应收利息	6.4.7.5	3,948.89	7,062.21
应收股利		-	-
应收申购款		482,219.83	1,189.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		293,209,826.09	243,942,873.92
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	8,070,633.89
应付赎回款		7,869,141.12	2,057,215.22
应付管理人报酬		249,553.70	244,393.19
应付托管费		54,901.84	53,766.49
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	183,237.94	379,257.51
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	179,109.51	147,753.22
负债合计		8,535,944.11	10,953,019.52
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	332,356,948.17	220,612,450.03
未分配利润	6.4.7.10	-47,683,066.19	12,377,404.37
所有者权益合计		284,673,881.98	232,989,854.40

负债和所有者权益总计		293, 209, 826. 09	243, 942, 873. 92
------------	--	-------------------	-------------------

注：1、报告截止日 2016 年 6 月 30 日，融通中证军工指数分级证券投资基金(以下简称“融通中证军工基金”)之基础份额净值 0.845 元，融通中证军工基金之 A 份额参考净值 1.030 元，融通中证军工基金之 B 份额参考净值 0.660 元；基金份额总额 336, 746, 140. 97 份，其中融通中证军工基金之基础份额 91, 469, 488. 97 份，融通中证军工基金之 A 份额 122, 638, 326. 00 份，融通中证军工基金之 B 份额 122, 638, 326. 00 份。

2、本基金合同生效日为 2015 年 7 月 1 日，本报告期的利润表及所有者权益（基金净值）变动表无同期对比数据。

6.2 利润表

会计主体：融通中证军工指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		-36, 621, 974. 72
1. 利息收入		82, 091. 11
其中：存款利息收入	6. 4. 7. 11	82, 091. 11
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		-18, 558, 376. 46
其中：股票投资收益	6. 4. 7. 12	-19, 235, 136. 81
基金投资收益		-
债券投资收益	6. 4. 7. 13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	6. 4. 7. 14	-
衍生工具收益	6. 4. 7. 15	-
股利收益	6. 4. 7. 16	676, 760. 35
3. 公允价值变动收益	6. 4. 7. 17	-18, 355, 190. 77
4. 汇兑收益		-
5. 其他收入	6. 4. 7. 18	209, 501. 40
减：二、费用		2, 244, 701. 09
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	1, 262, 186. 90
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	277, 681. 15
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	-
4. 交易费用	6. 4. 7. 19	496, 252. 54
5. 利息支出		-

其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6. 4. 7. 20	208, 580. 50
三、利润总额		-38, 866, 675. 81
减：所得税费用		-
四、净利润		-38, 866, 675. 81

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通中证军工指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	220, 612, 450. 03	12, 377, 404. 37	232, 989, 854. 40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-38, 866, 675. 81	-38, 866, 675. 81
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	111, 744, 498. 14	-21, 193, 794. 75	90, 550, 703. 39
其中：1. 基金申购款	315, 199, 322. 85	-57, 042, 850. 17	258, 156, 472. 68
2. 基金赎回款	-203, 454, 824. 71	35, 849, 055. 42	-167, 605, 769. 29
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	332, 356, 948. 17	-47, 683, 066. 19	284, 673, 881. 98

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>孟朝霞</u>	<u>颜锡廉</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

融通中证军工指数分级证券投资基金(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[2015] 1151 号《关于准予融通中证军工指数分级证券投资基金注册的批复》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《融通中证军工指数分级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基金, 存续期限不定, 首次设立募集不包括认购资金利息共募集 370, 629, 296. 14 元, 业经普华永道中天会计师事

务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 846 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《融通中证军工指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 7 月 1 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 370,677,558.08 份基金份额,其中认购资金利息折合 48,261.94 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《融通中证军工指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定,根据对基金财产及收益分配的不同安排,本基金的基金份额具有不同的风险收益特征,本基金的基金份额包括融通中证军工指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“融通军工份额”)、融通中证军工指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“融通军工 A 份额”)及融通中证军工指数分级证券投资基金之积极收益类份额(以下简称“融通军工 B 份额”)。投资人在场外认/申购的融通军工份额不进行基金份额分拆;投资人在场内认购的融通军工份额将在基金发售结束后进行基金份额自动分离;投资人在场内申购的融通军工份额,可选择进行基金份额分拆,也可选择不进行基金份额分拆。融通军工 A 份额指融通军工份额按基金合同约定规则所自动分离或分拆的稳健收益类基金份额。融通军工 B 份额指融通军工份额按基金合同约定规则所自动分离或分拆的积极收益类基金份额。融通军工 A 份额、融通军工 B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比例不变。本基金的基金份额初始公开发售结束后,场外认购的全部份额确认为融通军工份额;场内认购的份额将按照 1:1 的比例确认为融通军工 A 份额与融通军工 B 份额。本基金基金合同生效后,融通军工份额与融通军工 A 份额、融通军工 B 份额之间可以按约定的规则进行场内份额配对转换,包括基金份额的分拆和合并两种转换行为。基金份额的分拆,指基金份额持有人将其持有的融通军工份额按照 2 份融通军工份额对应 1 份融通军工 A 份额与 1 份融通军工 B 份额的比例进行转换的行为;基金份额的合并,指基金份额持有人将其持有的融通军工 A 份额与融通军工 B 份额按照 1 份融通军工 A 份额与 1 份融通军工 B 份额对应 2 份融通军工份额的比例进行转换的行为。

基金份额的净值按如下原则计算:融通军工份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数,其中基金份额总数为融通军工份额、融通军工 A 份额、融通军工 B 份额的份额数之和。融通军工 A 份额的基金份额净值为融通军工 A 份额的本金及约定应得收益之和。每 2 份融通军工份额所代表的基金资产净值等于 1 份融通军工 A 份额和 1 份融通军工 B 份额的基金资产净值之和。

本基金定期进行份额折算。在每年 12 月 15 日(若该日为非工作日,则提前至该日之前的最后一个工作日),本基金将进行融通军工 A 份额和融通军工份额的定期份额折算。在基金份额折算前与折算后,融通军工 A 份额与融通军工 B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。基金份额折算基准日折算前融通军工 A 份额的基金份额参考净值超出 1.000 元的部分将折算为融通军工份额的场内份

额分配给融通军工 A 份额持有人。融通军工份额持有人持有的每两份融通军工份额将按一份融通军工 A 份额获得新增融通军工份额的分配。持有场外融通军工份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外融通军工份额的分配；持有场内融通军工份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内融通军工份额的分配。经过上述份额折算，融通军工 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元，融通军工份额的基金份额净值将相应调整。

除定期份额折算外，本基金还将在融通军工份额的基金份额净值高至 1.500 元或以上、融通军工 B 份额的基金份额参考净值低至 0.250 元或以下时进行不定期份额折算。当融通军工份额的基金份额净值高至 1.500 元或以上，本基金将分别对融通军工 B 份额和融通军工份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保融通军工 A 份额和融通军工 B 份额的比例为 1:1，份额折算后融通军工 B 份额的基金份额参考净值和融通军工份额的基金份额净值超过融通军工 A 份额的基金份额参考净值的部分，折算成场内的融通军工份额。份额折算后融通军工份额的基金份额净值、融通军工 B 份额的基金份额参考净值与折算基准日融通军工 A 份额的基金份额参考净值三者相等。当融通军工 B 份额的基金份额参考净值低至 0.250 元或以下，本基金将分别对融通军工 A 份额、融通军工 B 份额和融通军工份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保融通军工 A 份额和融通军工 B 份额的比例为 1:1，份额折算后融通军工份额的基金份额净值、融通军工 A 份额和融通军工 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。融通军工份额、融通军工 A 份额和融通军工 B 份额的份额数将相应缩减。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2015]第 337 号文审核同意，本基金融通军工 A 份额 98,485,962.00 份基金份额和融通军工 B 份额 98,485,962.00 份基金份额于 2015 年 7 月 13 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的融通军工份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为融通军工 A 份额和融通军工 B 份额即可上市流通；对于托管在场外的融通军工份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深交所场内后分拆为融通军工 A 份额和融通军工 B 份额即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通中证军工指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、权证、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于中证军工指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%，

权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金的业绩比较基准： $95\% \times \text{中证军工价格指数收益率} + 5\% \times \text{银行人民币活期存款利率}$ （税后）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、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》、《融通中证军工指数分级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。

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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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》[适用于开放式基金]、财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，

金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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，股权的股息、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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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。

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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	19,912,890.06
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	19,912,890.06

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	285,036,369.16	269,329,740.43	-15,706,628.73
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	285,036,369.16	269,329,740.43	-15,706,628.73

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.1 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	3,689.19
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	197.10
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	62.60
合计	3,948.89

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	183,237.94
银行间市场应付交易费用	-
合计	183,237.94

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
----	-------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	29,657.43
预提费用	99,452.08
指数使用费	50,000.00
合计	179,109.51

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	223,509,071.70	220,612,450.03
本期申购	319,388,238.00	315,199,322.85
本期赎回（以“-”号填列）	-206,151,168.73	-203,454,824.71
本期末	336,746,140.97	332,356,948.17

注：截至 2016 年 6 月 30 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 252,158,160.00 份，其中融通军工 A 份额为 122,638,326.00 份，融通军工 B 份额为 122,638,326.00 份。托管在深交所场内未上市的基金份额为 6,881,508.00 份，托管在场外未上市的基金份额为 84,587,980.97 份，均为融通军工份额。场内的基金份额登记在证券登记结算系统，其中上市的基金份额可选择按市价流通，未上市的基金份额可按基金份额净值申购赎回；场外未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回，通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-732,377.03	13,109,781.40	12,377,404.37
本期利润	-20,511,485.04	-18,355,190.77	-38,866,675.81
本期基金份额交易产生的变动数	-4,616,543.31	-16,577,251.44	-21,193,794.75
其中：基金申购款	-14,056,856.47	-42,985,993.70	-57,042,850.17
基金赎回款	9,440,313.16	26,408,742.26	35,849,055.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-25,860,405.38	-21,822,660.81	-47,683,066.19

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
	活期存款利息收入
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	5,179.00
其他	1,297.33
合计	82,091.11

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	134,840,461.02
减：卖出股票成本总额	154,075,597.83
买卖股票差价收入	-19,235,136.81

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益/损失。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益/损失。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益/损失。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	676,760.35
基金投资产生的股利收益	-
合计	676,760.35

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-18,355,190.77
——股票投资	-18,355,190.77
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-

——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-18,355,190.77

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	208,283.91
转换费收入	1,217.49
合计	209,501.40

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	496,252.54
银行间市场交易费用	-
合计	496,252.54

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	49,726.04
上市费	29,835.26
银行费用	8,728.42
指数使用费	100,000.00
其他	400.00
合计	208,580.50

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需要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	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（中国建设银行）	基金托管人、基金代销机构

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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期未无应支付关联方的佣金。

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 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,262,186.90
其中：支付销售机构的客户维护费	148,140.91

注：1、支付基金管理人融通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

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

6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
当期发生的基金应支付的托管费	277,681.15	

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.22% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.22\% / \text{当年天数}。$$

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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末，基金管理人主要股东及其控制的机构均未持有本基金份额。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	19,912,890.06	75,614.78

注：本基金的活期存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金本报告期末未买入管理人、托管人的控股股东在承销期内担任副主承销商或分销商所承销的证券；

2、本基金本报告期末未买入管理人、托管人的主要股东（非控股）在承销期内承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项的说明。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016 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

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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
002465	海格通信	2016-6-13	重大事项停牌	12.44	-	-	855,459	12,585,984.83	10,641,909.96	-
000547	航天发展	2016-4-19	资产重组	15.36	-	-	329,900	5,708,708.57	5,067,264.00	-
002297	博云新材	2016-6-20	资产重组	13.09	-	-	150,500	1,837,573.87	1,970,045.00	-
002046	轴研科技	2016-5-9	资产重组	10.33	2016-8-22	11.36	90,618	911,735.51	936,083.94	-

注：本基金截至 2016 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

本基金本报告期末未持有因从事银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因从事交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

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，具有较高预期风险、较高预期收益的特征。本基金采用完全复制法进行投资，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动对投资组合进行相应调整。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。本基金在严格控制风险的基础上，追求基金资产的长期稳定增值。

本基金的基金管理人奉行建设全面风险管理体系、风控优先的政策，在董事会下设立合规与审计委员会，负责检查公司合规运作的状况及合规控制的有效性，并对公司的合规控制提出相关要求；在管理层层面设立风险控制委员会，负责建立健全公司的风险管理制度并组织实施，审定公司的业务风险管理政策，审定公司内控管理组织实施方案，审定公司的业务授权方案，审定基金资产组合的风险状况评价分析报告，审定公司各项风险与内控状况评价报告，审定业务风险损失责任人的责任，审定重大业务可行性风险论证，协调突发性重大风险事件的处理；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，具有根据业务特点控制业务风险的职责。业务人员是风险控制环节的第一责任人，部门负责人是控制业务风险管理的第一责任人，对部门风险控制措施的实施情况进行管理；风险管理小组由投资经理、金融工程人员和研究员组成，负责制定相关业务风险的识别和度量方法，指导业务部门实施风险的管理和控制，并定期出具投资组合风险报告，进行投资风险分析与绩效评估；督察长和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，确保既定的风险控制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。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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行中国建设银行，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。

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 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。

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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持全部证券在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

于 2016 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(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 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、结算备付金及存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
2016 年 6 月 30 日					
资产					
银行存款	19,912,890.06	-	-	-	19,912,890.06
结算备付金	438,098.24	-	-	-	438,098.24
存出保证金	139,217.20	-	-	-	139,217.20
交易性金融资产	-	-	-	269,329,740.43	269,329,740.43
应收证券清算款	-	-	-	2,903,711.44	2,903,711.44
应收利息	-	-	-	3,948.89	3,948.89
应收申购款	-	-	-	482,219.83	482,219.83
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	20,490,205.50	-	-	272,719,620.59	293,209,826.09
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	7,869,141.12	7,869,141.12
应付管理人报酬	-	-	-	249,553.70	249,553.70
应付托管费	-	-	-	54,901.84	54,901.84
应付交易费用	-	-	-	183,237.94	183,237.94
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	179,109.51	179,109.51
负债总计	-	-	-	8,535,944.11	8,535,944.11
利率敏感性缺口	20,490,205.50	-	-	264,183,676.48	284,673,881.98
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
2015 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	24,712,504.27	-	-	-	24,712,504.27

结算备付金	135,195.31	-	-	-	135,195.31
存出保证金	57,658.46	-	-	-	57,658.46
交易性金融资产	-	-	-	219,029,263.78	219,029,263.78
应收利息	-	-	-	7,062.21	7,062.21
应收申购款	-	-	-	1,189.89	1,189.89
资产总计	24,905,358.04	-	-	219,037,515.88	243,942,873.92
负债					
应付证券清算款	-	-	-	8,070,633.89	8,070,633.89
应付赎回款	-	-	-	2,057,215.22	2,057,215.22
应付管理人报酬	-	-	-	244,393.19	244,393.19
应付托管费	-	-	-	53,766.49	53,766.49
应付交易费用	-	-	-	379,257.51	379,257.51
其他负债	-	-	-	147,753.22	147,753.22
负债总计	-	-	-	10,953,019.52	10,953,019.52
利率敏感度缺口	24,905,358.04	-	-	208,084,496.36	232,989,854.40

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 2016 年 6 月 30 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的股票，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。

本基金采用完全复制法进行投资，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动对投资组合进行相应调整。

本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于中证军工指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%，权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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 2016年6月30日		上年度末 2015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	269,329,740.43	94.61	219,029,263.78	94.01
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	269,329,740.43	94.61	219,029,263.78	94.01

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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。

本基金为被动式指数基金, 采用完全复制法进行投资, 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对投资组合进行相应调整。当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为导致成份股的构成及权重发生变化时, 或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时, 或因交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时, 基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合, 力求降低跟踪误差。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%, 其中投资于标的指数成份股及和备先成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%。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。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	269,329,740.43	91.86
	其中：股票	269,329,740.43	91.86
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	20,350,988.30	6.94
7	其他各项资产	3,529,097.36	1.20
8	合计	293,209,826.09	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	246,685,246.02	86.66
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	2,719,105.65	0.96
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	17,750,599.06	6.24
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	2,174,789.70	0.76
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	269,329,740.43	94.61

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末无积极投资部分的股票。

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	占基金资产净值比例(%)
1	601989	中国重工	3,886,872	24,603,899.76	8.64
2	600893	中航动力	317,498	11,001,305.70	3.86
3	600271	航天信息	447,962	10,661,495.60	3.75
4	002465	海格通信	855,459	10,641,909.96	3.74
5	000768	中航飞机	428,396	8,435,117.24	2.96
6	600118	中国卫星	236,802	7,956,547.20	2.80
7	600150	中国船舶	267,587	5,956,486.62	2.09
8	002179	中航光电	125,358	5,430,508.56	1.91
9	300159	新研股份	300,600	5,425,830.00	1.91
10	600879	航天电子	337,048	5,251,207.84	1.84
11	600482	中国动力	158,647	5,198,862.19	1.83
12	000748	长城信息	261,659	5,133,749.58	1.80
13	000547	航天发展	329,900	5,067,264.00	1.78
14	000738	中航动控	186,309	4,918,557.60	1.73
15	300101	振芯科技	171,932	4,802,060.76	1.69
16	300324	旋极信息	211,220	4,532,781.20	1.59
17	002049	紫光国芯	100,401	4,412,623.95	1.55
18	002224	三力士	184,100	4,261,915.00	1.50
19	002544	杰赛科技	128,300	4,114,581.00	1.45
20	600372	中航电子	209,616	4,081,223.52	1.43
21	600151	航天机电	353,388	3,993,284.40	1.40
22	600038	中直股份	95,152	3,946,904.96	1.39
23	600435	北方导航	293,642	3,908,375.02	1.37

24	002023	海特高新	215,710	3,738,254.30	1.31
25	600343	航天动力	155,500	3,697,790.00	1.30
26	000901	航天科技	91,490	3,673,323.50	1.29
27	002268	卫士通	102,349	3,657,953.26	1.29
28	600391	成发科技	93,200	3,583,540.00	1.26
29	600990	四创电子	40,300	3,493,607.00	1.23
30	002013	中航机电	258,568	3,485,496.64	1.22
31	600316	洪都航空	171,045	3,337,087.95	1.17
32	600562	国睿科技	95,806	3,285,187.74	1.15
33	002151	北斗星通	91,793	3,089,752.38	1.09
34	000733	振华科技	136,200	3,064,500.00	1.08
35	002368	太极股份	83,920	2,981,677.60	1.05
36	600855	航天长峰	95,000	2,973,500.00	1.04
37	600967	北方创业	266,900	2,837,147.00	1.00
38	000519	江南红箭	222,537	2,828,445.27	0.99
39	300053	欧比特	155,412	2,820,727.80	0.99
40	300252	金信诺	84,638	2,804,056.94	0.99
41	600677	航天通信	147,377	2,719,105.65	0.96
42	300065	海兰信	70,146	2,713,247.28	0.95
43	600765	中航重机	184,707	2,693,028.06	0.95
44	002414	高德红外	98,042	2,644,192.74	0.93
45	002025	航天电器	105,700	2,609,733.00	0.92
46	000801	四川九洲	209,438	2,580,276.16	0.91
47	603678	火炬电子	33,400	2,545,748.00	0.89
48	002253	川大智胜	65,960	2,463,606.00	0.87
49	600685	中船防务	96,920	2,457,891.20	0.86
50	300045	华力创通	118,861	2,276,188.15	0.80
51	300034	钢研高纳	102,110	2,256,631.00	0.79
52	002413	雷科防务	164,010	2,251,857.30	0.79
53	002260	德奥通航	85,875	2,228,456.25	0.78
54	300008	天海防务	65,309	2,174,789.70	0.76
55	002297	博云新材	150,500	1,970,045.00	0.69
56	002111	威海广泰	74,900	1,969,121.00	0.69
57	600456	宝钛股份	88,859	1,787,843.08	0.63
58	300177	中海达	107,255	1,625,985.80	0.57
59	002519	银河电子	72,000	1,614,240.00	0.57
60	002214	大立科技	130,420	1,608,078.60	0.56
61	600501	航天晨光	83,899	1,543,741.60	0.54
62	600480	凌云股份	109,168	1,539,268.80	0.54

63	002338	奥普光电	25,042	1,538,830.90	0.54
64	300114	中航电测	49,165	1,465,117.00	0.51
65	600184	光电股份	63,300	1,433,112.00	0.50
66	600815	厦工股份	220,500	1,404,585.00	0.49
67	000561	烽火电子	121,400	1,349,968.00	0.47
68	600523	贵航股份	57,922	1,076,190.76	0.38
69	300123	太阳鸟	72,700	1,020,708.00	0.36
70	300447	全信股份	21,706	969,607.02	0.34
71	002046	轴研科技	90,618	936,083.94	0.33
72	300354	东华测试	28,824	773,924.40	0.27

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

本基金本报告期末无积极投资部分的股票。

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	601989	中国重工	17,228,917.00	7.39
2	600893	中航动力	9,646,072.04	4.14
3	600271	航天信息	9,522,723.00	4.09
4	000748	长城信息	8,120,979.00	3.49
5	000768	中航飞机	6,721,708.40	2.88
6	002465	海格通信	6,697,851.10	2.87
7	600118	中国卫星	6,450,028.09	2.77
8	600150	中国船舶	5,371,399.30	2.31
9	300159	新研股份	5,210,276.28	2.24
10	300324	旋极信息	4,965,537.00	2.13
11	600839	四川长虹	4,914,526.00	2.11
12	000738	中航动控	4,564,111.00	1.96
13	600482	中国动力	4,220,674.00	1.81
14	002224	三力士	4,140,311.75	1.78
15	600967	北方创业	3,808,956.08	1.63
16	002544	杰赛科技	3,767,561.00	1.62
17	601890	亚星锚链	3,663,638.67	1.57
18	600879	航天电子	3,631,670.27	1.56
19	002179	中航光电	3,471,354.12	1.49

20	000901	航天科技	3,440,320.68	1.48
----	--------	------	--------------	------

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	600839	四川长虹	10,752,162.76	4.61
2	601989	中国重工	7,508,744.29	3.22
3	600893	中航动力	6,252,345.75	2.68
4	601890	亚星锚链	5,244,229.02	2.25
5	000768	中航飞机	4,914,031.66	2.11
6	600118	中国卫星	4,436,012.04	1.90
7	600150	中国船舶	3,859,399.50	1.66
8	600271	航天信息	3,588,553.02	1.54
9	000519	江南红箭	3,274,200.45	1.41
10	000738	中航动控	2,815,458.07	1.21
11	600482	中国动力	2,813,543.00	1.21
12	002414	高德红外	2,541,708.23	1.09
13	002179	中航光电	2,447,435.80	1.05
14	600879	航天电子	2,390,223.61	1.03
15	600372	中航电子	2,321,170.00	1.00
16	600038	中直股份	2,154,550.26	0.92
17	002465	海格通信	2,117,752.30	0.91
18	002268	卫士通	2,113,259.04	0.91
19	600151	航天机电	2,085,095.32	0.89
20	600435	北方导航	2,082,613.00	0.89

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	222,731,265.25
卖出股票收入（成交）总额	134,840,461.02

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内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 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	139,217.20

2	应收证券清算款	2,903,711.44
3	应收股利	-
4	应收利息	3,948.89
5	应收申购款	482,219.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,529,097.36

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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

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	002465	海格通信	10,641,909.96	3.74	重大事项停牌

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

本基金本报告期末无积极投资部分的股票。

§ 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
融通军工分级	3,032.00	30,168.04	3,876,969.96	4.24%	87,592,519.01	95.76%
军工股 A	370.00	331,454.94	93,477,139.00	76.22%	29,161,187.00	23.78%
军工股 B	3,542.00	34,624.03	4,054,841.00	3.31%	118,583,485.00	96.69%
合计	6,944.00	396,247.01	101,408,949.96	30.11%	235,337,191.01	69.89%

8.2 期末上市基金前十名持有人

融通军工分级

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	上海明沘投资管理有限公司—明沘全天候一号基金	1,459,982.00	21.22%
2	上海欧肯投资管理有限公司—欧肯格致母基金	951,800.00	13.83%
3	上海明沘投资管理有限公司—明沘 CTA 二号基金	600,000.00	8.72%

4	陶隽	482,000.00	7.00%
5	上海千象资产管理有限公司一千象子基金 2 号	443,200.00	6.44%
6	上海均直孔最投资合伙企业（有限合伙）	250,000.00	3.63%
7	杜元钊	216,831.00	3.15%
8	施维捷	214,600.00	3.12%
9	秦丕举	200,000.00	2.91%
10	阎娟娟	187,400.00	2.72%

军工股 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国银河证券股份有限公司	26,368,619.00	21.50%
2	上海明沅投资管理有限公司—明沅 CTA 一号基金	9,424,462.00	7.68%
3	北京快快网络技术有限公司	8,080,142.00	6.59%
4	北京千石创富—招商银行—千石资本—华宝证券明沅套利 1 号资	6,619,294.00	5.40%
5	李怡名	6,473,616.00	5.28%
6	丁碧霞	6,403,329.00	5.22%
7	方正证券—招商银行—方正证券量化稳宝 CPPI1 号集合资产管理	4,151,700.00	3.39%
8	泰康人寿保险股份有限公司—分红—个人分红—019L-FH002 深	2,928,400.00	2.39%
9	上海明沅投资管理有限公司—明沅 CTA 二号基金	2,886,935.00	2.35%
10	方正证券—交通银行—方正证券量化宝利 1 号集合资产管理计划	2,810,537.00	2.29%

军工股 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	曾麟翔	4,001,000.00	3.26%
2	汤惠亮	1,924,071.00	1.57%
3	刘仁华	1,800,000.00	1.47%
4	嘉兴卓凯投资有限公司—卓凯一号	1,692,842.00	1.38%
5	陈明聪	1,260,050.00	1.03%
6	胡丹	1,159,100.00	0.95%
7	黄纯真	1,083,592.00	0.88%
8	何春华	1,081,000.00	0.88%
9	徐良英	1,000,000.00	0.82%
10	邢彦良	981,332.00	0.80%

注：持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
----	------	-----------	----------

基金管理人所有从业人员持有本基金	融通军工分级	36,997.86	0.0405%
	军工股 A	0.00	0.00
	军工股 B	0.00	0.00
	合计	36,997.86	0.0110%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通军工分级	军工股 A	军工股 B
基金合同生效日（2015 年 7 月 1 日）基金份额总额	370,677,558.08	-	-
本报告期期初基金份额总额	102,336,439.70	60,586,316.00	60,586,316.00
本报告期基金总申购份额	319,388,238.00	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	206,151,168.73	-	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-124,104,020.00	62,052,010.00	62,052,010.00
本报告期期末基金份额总额	91,469,488.97	122,638,326.00	122,638,326.00

注：拆分变动份额为本报告期发生的配对转换份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变更。

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，基金托管人无重大人事变更。

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日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的基金管理人、托管人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	
广发证券	1	81,016,870.57	22.66%	75,451.70	22.89%	-
长江证券	1	69,478,548.19	19.43%	63,317.20	19.20%	-
兴业证券	1	58,625,590.60	16.40%	54,598.20	16.56%	-
东方证券	1	52,044,406.52	14.55%	48,468.68	14.70%	-
中信建投	1	32,366,140.45	9.05%	29,495.38	8.95%	-
安信证券	2	26,192,691.70	7.33%	23,870.44	7.24%	-
中信证券	1	18,671,091.61	5.22%	17,015.53	5.16%	-
国信证券	1	13,072,987.63	3.66%	11,913.98	3.61%	-
平安证券	2	6,103,399.00	1.71%	5,562.10	1.69%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

招商证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	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

本报告期本基金新增华创证券交易单元 1 个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

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旗下部分基金开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、管理人网站	2016-2-25
2	融通基金管理有限公司关于参加上海陆金所资产管理有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、管理人网站	2016-3-7
3	融通关于旗下部分开放式基金新增代销机构并参加其申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、管理人网站	2016-3-24
4	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构并参加其申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、管理人网站	2016-3-24
5	融通基金管理有限公司关于参加上海陆金所资产管理有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、管理人网站	2016-4-20
6	融通基金管理有限公司关于对通过本公司直销中心赎回公司旗下部分基金的养老金客户实施特定赎回费率率的公告	中国证券报、上海证券报、管理人网站	2016-5-9
7	关于融通基金管理有限公司旗下开放式基金新增奕丰金融服务（深圳）有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、管理人网站	2016-5-13
8	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利得基金销售有限公司为代销机构并参加其申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、管理人网站	2016-5-13
9	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金在深圳市新兰德证券投资咨询有限公司开通定期定额投资业务及参加基金申购	中国证券报、上海证券报、管理人网站	2016-5-24
10	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好买基金销售有限公司为代销机构并参加其申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、管理人网站	2016-6-20
11	关于融通基金管理有限公司旗下开放式基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定期定额投资业务并	中国证券报、上海证券报、管理	2016-6-24

	参加其申购费率优惠活动	人网站	
--	-------------	-----	--

§ 11 备查文件目录

- (一)《融通中证军工指数分级证券投资基金基金合同》
- (二)《融通中证军工指数分级证券投资基金基金托管协议》
- (三)《融通中证军工指数分级证券投资基金基金招募说明书》及其更新
- (四)《融通中证军工指数分级证券投资基金之军工股 A 和军工股 B 上市交易公告书》
- (五)《融通基金管理有限公司开放式基金业务管理规则》
- (六)融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- (七)报告期内在指定报刊上披露的各项公告

存放地点：基金管理人处、基金托管人处、深圳证券交易所

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