

# 融通创业板指数增强型证券投资基金 2018 年半年度报告摘要

2018 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：2018 年 8 月 27 日

## § 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据融通创业板指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同规定，于 2018 年 8 月 22 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	融通创业板指数	
基金主代码	161613	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 4 月 6 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	1,019,657,737.89 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	融通创业板指数 A/B	融通创业板指数 C
下属分级基金的交易代码:	161613	004870
下属分级基金的前端交易代码	161613	-
下属分级基金的后端交易代码	161663	-
报告期末下属分级基金的份额总额	1,019,416,841.25 份	240,896.64 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在基金合同规定的范围内，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，结合增强收益的主动投资，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度控制在 0.5%以内、年化跟踪误差控制在 7.75%以内、基
------	---

	金总体投资业绩超越创业板指数的表现。
投资策略	本基金为增强型指数基金，对指数投资部分，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。本基金对主动投资部分采取积极配置策略，力争在跟踪误差控制范围内，获取超越基准的业绩表现。
业绩比较基准	创业板指数收益率×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	郭明
	联系电话	(0755) 26948666	(010) 66105798
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-883-8088、(0755) 26948088	95588
传真		(0755) 26935005	(010) 66105799

## 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.rtfund.com">http://www.rtfund.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## § 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

基金级别	融通创业板指数 A/B	融通创业板指数 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	-21,617,959.96	-7,004.77
本期利润	-34,568,045.55	21,542.22
加权平均基金份额本期利润	-0.0485	0.1176
本期基金份额净值增长率	-5.88%	-5.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	-0.2398	-0.2324
期末基金资产净值	784,233,940.22	184,910.04
期末基金份额净值	0.769	0.768

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

融通创业板指数 A/B

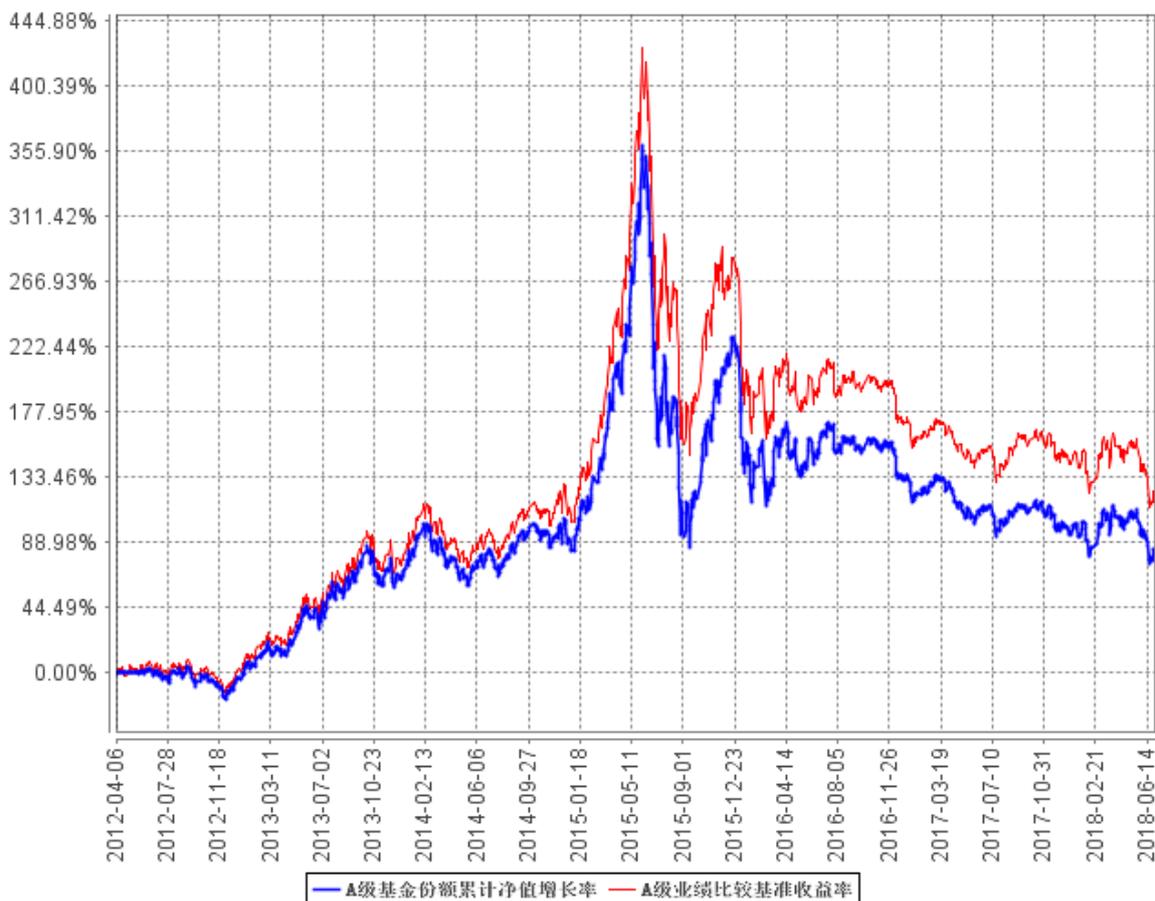
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.56%	1.93%	-7.46%	1.97%	0.90%	-0.04%
过去三个月	-13.69%	1.54%	-14.71%	1.55%	1.02%	-0.01%
过去六个月	-5.88%	1.67%	-7.84%	1.67%	1.96%	0.00%
过去一年	-13.11%	1.39%	-10.95%	1.39%	-2.16%	0.00%
过去三年	-43.37%	2.13%	-41.67%	1.99%	-1.70%	0.14%
自基金合同生效起至今	84.38%	1.99%	124.45%	1.92%	-40.07%	0.07%

融通创业板指数 C

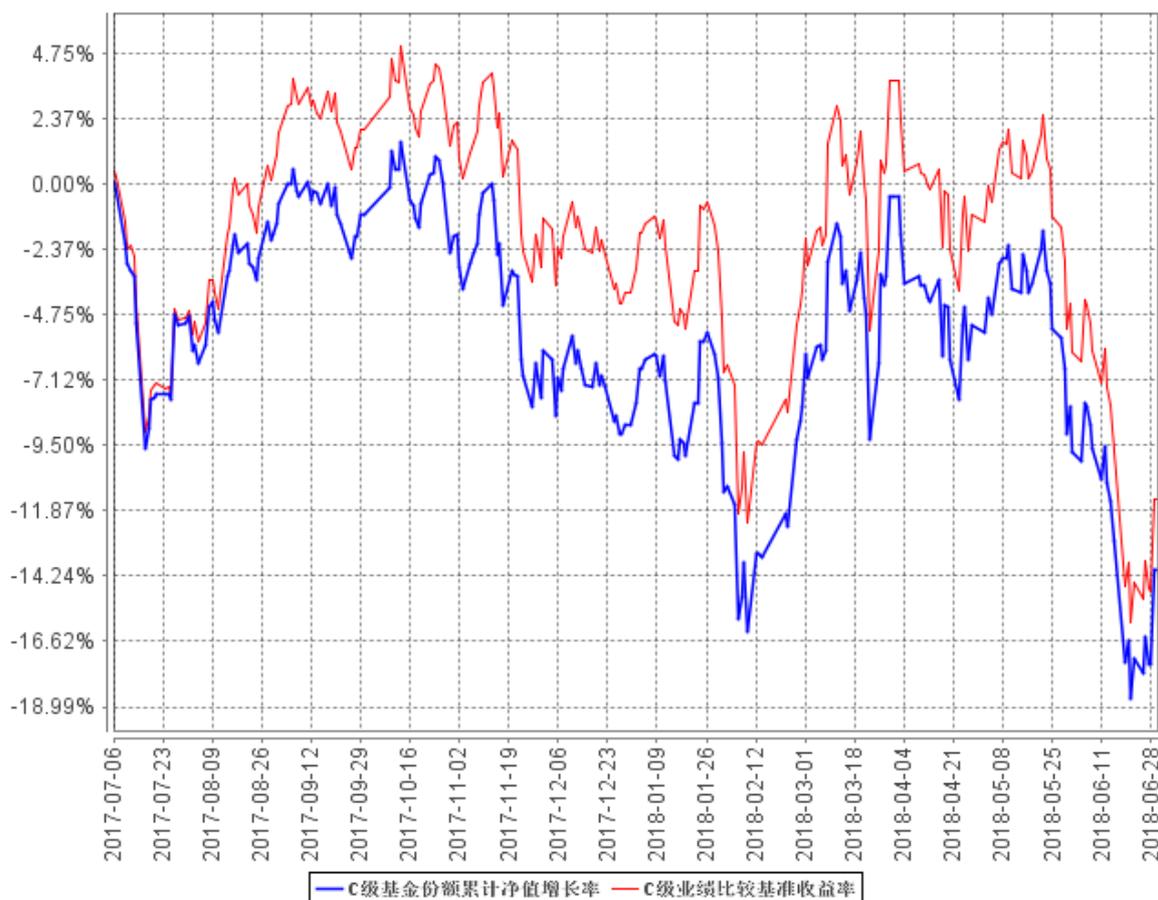
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.46%	1.95%	-7.46%	1.97%	1.00%	-0.02%
过去三个月	-13.61%	1.54%	-14.71%	1.55%	1.10%	-0.01%
过去六个月	-5.77%	1.66%	-7.84%	1.67%	2.07%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-14.00%	1.39%	-11.81%	1.39%	-2.19%	0.00%

### 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

A级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



C级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：本基金于 2017 年 7 月 5 日增设 C 类份额，该类份额的统计期间为 2017 年 7 月 6 日至本报告期末。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2018 年 6 月 30 日，公司共管理六十六只开放式基金：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、融通动力先锋混合基金、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、融通汇财宝货币基金、融通可转债债券基金、融通通泰保本混合基金、融通通福债券基金 (LOF)、融通通源短融债券基金、融通通瑞债券基金、融通月月添利定期开放债券基金、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、融通新消费混合基金、融通通安债券基金、融通通优债券基金、融通通乾研究精选混合基金、融通新趋势混合基金、融通国企改革新机遇混合基金、融通通和债券基金、融通沪港深智慧生活混合基金、融通现金宝货币基金、融通通祺债券基金、融通稳利债券基金、融通通宸债券基金、融通通玺债券基金、融通通穗债券基金、融通通润债券基金、融通通颐定期开放债券基金、融通人工智能指数基金 (LOF)、融通新动力混合基金、融通收益增强债券基金、融通中国概念债券基金 (QDII)、融通逆向策略混合基金、融通通裕定期开放债券发起式基金、融通红利机会主题精选混合基金、融通通昊定期开放债券发起式基金、融通新能源汽车主题精选混合基金。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		
蔡志伟	本基金的基金经理	2016 年 11 月 19 日	-	7	蔡志伟先生，华南师范大学计算机硕士、广州大学计算机学士，金融风险管理师 (FRM)，7 年证券投资从业经历，具有基金从业资格。曾就职于汇丰软件开发广东有限公司任高级软件工程师 (SSE)。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，现任融通巨潮 100 指数 (LOF)、融通深证成份指数、融通创业板指数基金的基金经理。

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业务相关工作的时间为计算标准。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通创业板指数 A/B 基金份额净值为 0.769 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.88%；截至本报告期末融通创业板指数 C 基金份额净值为 0.768 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.77%；同期业绩比较基准收益率为-7.84%。

## 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 2018 年上半年，国内宏观经济总体保持平稳，GDP 同比增长 6.8%，连续 12 个季度保持在 6.7%-6.9% 的区间，经济韧性强；物价保持温和上涨，CPI 同比上涨 2%，6 月 PPI 上涨 4.7%，通胀压力不大。

展望下半年，宽货币和紧信用仍将是货币政策的主基调，但是央行会对货币宽松的程度相机抉择，防止市场对信用违约过度恐慌。同时，在中美长期博弈的影响下，市场流动性环境整体偏

紧、风险偏好不时受到扰动。

从市场估值的角度看，在上半年宏观去杠杆以及贸易战的扰动下，当前估值已回到历史底部区域，继续往下空间有限；而从盈利的角度看，伴随中国 2016 年度过产能周期拐点后，A 股盈利能力持续处于较高水平，体现在经济新常态下量增长平稳，而质提升明显。而从政策的角度看，从三去到一补，预计下半年有望开启。从全球范围看制造业是中国优势产业，智能制造既能够提升传统制造业的竞争力，又能够形成新的增长点，将是中国产业发展的重点方向。我国的产业升级将以互联网、大数据、人工智能和实体经济深度融合为突破口，推动我国产业向产业链中高端转移。

在此宏观产业背景下，展望 2018 年下半年，A 股有望震荡上行。这主要源于市场估值已处历史底部，本轮企业盈利回升将可持续。从结构来看，优秀成长股盈利趋势向好，预计下半年将能产生较好的 Alpha。从行业的角度看，符合中国产业升级的智能制造如新能源汽车、5G、AI、医疗健康和有自主可控替代迫切性的集成电路、大飞机、信息安全等将有较好的投资机会。

具体到本基金跟踪的创业板指，估值水平已回到历史底部，而从中报业绩预告来看，创业板指成分股总体盈利正在稳步恢复，预计年内将恢复至历史中位水平，创业板当前具有较高的投资价值。且基于当前中国经济转型的大背景，从三去到一补中，作为新兴行业龙头集中的创业板指数将可能享受一定成长的溢价。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 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，本基金托管人在对融通创业板指数增强型证券投资基金的托管过程中，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，融通创业板指数增强型证券投资基金的管理人——融通管理有限公司在融通创业板指数增强型证券投资基金的投资运作、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。

本报告期内，融通创业板指数增强型证券投资基金未进行利润分配。

#### 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

本托管人依法对融通基金管理有限公司编制和披露的融通创业板指数增强型证券投资基金 2018 年半年度报告中财务指标、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：融通创业板指数增强型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>		
银行存款	35,020,144.00	14,531,441.91
结算备付金	113,143.57	182,643.35
存出保证金	56,711.73	25,155.99
交易性金融资产	775,830,637.89	463,442,642.63
其中: 股票投资	745,768,227.89	446,112,754.95
基金投资	-	-
债券投资	30,062,410.00	17,329,887.68
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	369,115.50	332,934.08
应收股利	-	-
应收申购款	2,646,713.14	1,438,157.95
递延所得税资产	-	-
其他资产	54,290.28	54,290.28
资产总计	814,090,756.11	480,007,266.19
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b> <b>2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末</b> <b>2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债:</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	6,179.32	-
应付赎回款	28,346,205.09	2,361,657.61
应付管理人报酬	543,051.38	407,005.45
应付托管费	108,610.28	81,401.09
应付销售服务费	31.09	178.25
应付交易费用	395,827.46	359,145.08
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	272,001.23	53,447.28
负债合计	29,671,905.85	3,262,834.76
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	1,019,657,737.89	583,674,742.93
未分配利润	-235,238,887.63	-106,930,311.50

所有者权益合计	784,418,850.26	476,744,431.43
负债和所有者权益总计	814,090,756.11	480,007,266.19

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，融通创业板指数 A/B 基金份额净值 0.769 元，基金份额总额 1,019,416,841.25 份；融通创业板指数 C 基金份额净值 0.768 元，基金份额总额 240,896.64 份。融通创业板指数份额总额合计为 1,019,657,737.89 份。

## 6.2 利润表

会计主体：融通创业板指数增强型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	-30,096,638.15	-37,474,520.88
1. 利息收入	279,437.58	215,872.06
其中：存款利息收入	90,869.47	67,244.66
债券利息收入	188,568.11	148,627.40
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	-17,834,661.01	-64,101,194.69
其中：股票投资收益	-20,845,050.12	-66,599,484.51
基金投资收益	-	-
债券投资收益	352,718.15	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	2,657,670.96	2,498,289.82
3. 公允价值变动收益	-12,921,538.60	26,173,326.30
4. 汇兑收益	-	-
5. 其他收入	380,123.88	237,475.45
<b>减：二、费用</b>	4,449,865.18	4,849,266.29
1. 管理人报酬	2,902,627.15	2,439,858.25
2. 托管费	580,525.47	487,971.66
3. 销售服务费	287.57	-
4. 交易费用	795,144.88	1,750,155.37
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	1.10	-
7. 其他费用	171,279.01	171,281.01
<b>三、利润总额</b>	-34,546,503.33	-42,323,787.17

减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润</b>	-34,546,503.33	-42,323,787.17

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通创业板指数增强型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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)	583,674,742.93	-106,930,311.50	476,744,431.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-34,546,503.33	-34,546,503.33
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	435,982,994.96	-93,762,072.80	342,220,922.16
其中：1. 基金申购款	782,631,422.48	-153,561,056.78	629,070,365.70
2. 基金赎回款	-346,648,427.52	59,798,983.98	-286,849,443.54
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)	1,019,657,737.89	-235,238,887.63	784,418,850.26
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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)	480,862,145.74	-15,262,778.29	465,599,367.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-42,323,787.17	-42,323,787.17
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	96,523,095.56	-8,654,758.87	87,868,336.69
其中：1. 基金申购款	315,831,065.75	-25,169,289.40	290,661,776.35

2. 基金赎回款	-219,307,970.19	16,514,530.53	-202,793,439.66
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)	577,385,241.30	-66,241,324.33	511,143,916.97

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张帆                                      颜锡廉                                      刘美丽  
 基金管理人负责人                      主管会计工作负责人                      会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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。

### 6.4.2 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。

### 6.4.3 关联方关系

#### 6.4.3.1 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。

#### 6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
融通基金管理有限公司(“融通基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

#### 6.4.4.2 关联方报酬

##### 6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月
----	-----------------------	------------------------------

	6 月 30 日	30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,902,627.15	2,439,858.25
其中：支付销售机构的客户维护费	1,180,716.37	1,050,234.11

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。

#### 6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	580,525.47	487,971.66

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

#### 6.4.4.2.3 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		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通创业板指数 A/B	融通创业板指数 C	合计
中国工商银行	-	271.64	271.64
合计	-	271.64	271.64
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	融通创业板指数 A/B	融通创业板指数 C	合计
中国工商银行	-	-	-
合计	-	-	-

#### 6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间本基金管理人未运用自有资金投资本基金。

##### 6.4.4.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.4.5 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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	35,020,144.00	86,927.91	10,048,480.48	40,437.00

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

基金本报告期内及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

#### 6.4.5 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.5.2 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	停牌	停	期末	复牌	复牌	数量（股）	期末	期末估值总额	备注
------	---	----	---	----	----	----	-------	----	--------	----

码	票名称	日期	牌原因	估值单价	日期	开盘单价		成本总额		
300072	三聚环保	2018年6月19日	重大事项目	23.28	2018年7月10日	18.38	467,505	16,469,025.73	10,883,516.40	-
300146	汤臣倍健	2018年1月31日	重大事项目	16.60	2018年7月31日	16.50	321,139	4,595,559.22	5,330,907.40	-
300266	兴源环境	2018年2月5日	重大事项目	19.99	2018年7月2日	11.96	258,452	7,349,620.72	5,166,455.48	-
300324	旋极信息	2018年5月30日	重大事项目	9.49	-	-	442,422	5,282,055.33	4,198,584.78	-
300197	铁汉生态	2018年5月28日	重大事项目	5.37	-	-	653,850	5,342,272.35	3,511,174.50	-
300090	盛运环保	2018年6月4日	重大事项目	8.32	2018年7月2日	7.49	343,300	3,693,782.01	2,856,256.00	-
300118	东方日升	2018年5月7日	重大事项目	10.80	2018年8月7日	9.63	240,900	3,155,717.22	2,601,720.00	-
300317	珈伟股份	2018年2月5日	重大事项目	11.90	2018年7月3日	10.68	102,800	1,843,009.67	1,223,320.00	-

注：本基金截至 2018 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。

#### 6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.5.3.1 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。

### 6.4.5.3.2 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。

## § 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	745,768,227.89	91.61
	其中：股票	745,768,227.89	91.61
2	固定收益投资	30,062,410.00	3.69
	其中：债券	30,062,410.00	3.69
	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	35,133,287.57	4.32
7	其他各项资产	3,126,830.65	0.38
8	合计	814,090,756.11	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	59,671,645.68	7.61
B	采矿业	-	-
C	制造业	348,639,537.72	44.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,760,955.50	1.12
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	197,086,151.25	25.13
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,223,525.60	0.67
M	科学研究和技术服务业	3,146,325.00	0.40

N	水利、环境和公共设施管理业	26,511,135.89	3.38
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	37,921,195.81	4.83
R	文化、体育和娱乐业	34,130,190.16	4.35
S	综合	-	-
	合计	721,090,662.61	91.93

### 7.2.2 期末积极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	18,561,637.28	2.37
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	6,115,928.00	0.78
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	24,677,565.28	3.15

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 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前十名股票投资明细

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	300498	温氏股份	2,709,884	59,671,645.68	7.61
2	300059	东方财富	2,779,784	36,637,553.12	4.67
3	300003	乐普医疗	650,748	23,869,436.64	3.04
4	300124	汇川技术	700,928	23,004,456.96	2.93
5	300015	爱尔眼科	590,782	19,076,350.78	2.43
6	300408	三环集团	770,771	18,113,118.50	2.31
7	300136	信维通信	563,659	17,321,241.07	2.21
8	300024	机器人	979,220	17,038,428.00	2.17
9	300142	沃森生物	832,873	16,640,802.54	2.12
10	300070	碧水源	1,175,737	16,378,016.41	2.09

### 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前五名股票投资明细

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	300413	快乐购	161,200	6,115,928.00	0.78
2	300308	中际装备	93,400	5,607,736.00	0.71
3	300285	国瓷材料	265,400	5,292,076.00	0.67
4	300699	光威复材	74,500	3,367,400.00	0.43
5	300474	景嘉微	54,300	2,523,864.00	0.32

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人融通基金管理有限公司网站(<http://www.rtfund.com>)的年度报告正文。

### 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	300498	温氏股份	35,032,284.45	7.35
2	300059	东方财富	20,457,159.71	4.29
3	300124	汇川技术	13,796,244.10	2.89
4	300003	乐普医疗	11,563,633.92	2.43
5	300136	信维通信	11,294,145.17	2.37
6	300024	机器人	11,197,406.28	2.35
7	300142	沃森生物	11,192,728.00	2.35

8	300601	康泰生物	11,098,399.81	2.33
9	300070	碧水源	9,747,256.00	2.04
10	300408	三环集团	9,504,079.00	1.99
11	300015	爱尔眼科	9,229,992.43	1.94
12	300296	利亚德	8,939,007.26	1.88
13	300347	泰格医药	7,514,251.36	1.58
14	300122	智飞生物	6,985,795.44	1.47
15	300413	快乐购	6,927,025.80	1.45
16	300308	中际装备	6,632,887.00	1.39
17	300558	贝达药业	6,602,936.08	1.39
18	300017	网宿科技	6,573,028.78	1.38
19	300144	宋城演艺	6,291,606.26	1.32
20	300618	寒锐钴业	6,088,914.00	1.28

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	300498	温氏股份	9,181,242.20	1.93
2	300124	汇川技术	5,973,038.85	1.25
3	300059	东方财富	4,729,034.00	0.99
4	300257	开山股份	3,842,870.00	0.81
5	300274	阳光电源	3,824,493.13	0.80
6	300077	国民技术	3,653,641.38	0.77
7	300136	信维通信	3,625,497.80	0.76
8	300104	乐视网	3,297,184.80	0.69
9	300003	乐普医疗	2,983,449.20	0.63
10	300297	蓝盾股份	2,854,871.00	0.60
11	300024	机器人	2,840,596.00	0.60
12	300101	振芯科技	2,766,825.00	0.58
13	300070	碧水源	2,733,756.00	0.57
14	300273	和佳股份	2,711,332.00	0.57
15	300408	三环集团	2,556,995.00	0.54
16	300142	沃森生物	2,528,052.00	0.53
17	300291	华录百纳	2,475,046.36	0.52

18	300185	通裕重工	2,357,064.00	0.49
19	300316	晶盛机电	2,356,099.00	0.49
20	300075	数字政通	2,317,049.00	0.49

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	487,746,749.73
卖出股票收入（成交）总额	154,215,884.87

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,062,410.00	3.83
	其中：政策性金融债	30,062,410.00	3.83
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	30,062,410.00	3.83

### 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	018005	国开 1701	250,000	25,095,000.00	3.20
2	018002	国开 1302	48,940	4,967,410.00	0.63

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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持有股指期货。

**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持有国债期货。

**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持有国债期货。

**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	56,711.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	369,115.50
5	应收申购款	2,646,713.14
6	其他应收款	54,290.28
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	3,126,830.65
---	----	--------------

#### 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

本基金本报告期末指数投资部分前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 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

本基金本报告期末积极投资部分前五名股票中不存在流通受限情况。

## § 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
融通创业板指数 A/B	40,322	25,281.90	270,216,577.90	26.51%	749,200,263.35	73.49%
融通创业板指数 C	42	5,735.63	0.00	0.00%	240,896.64	100.00%
合计	40,364	25,261.56	270,216,577.90	26.51%	749,441,159.99	73.49%

### 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	融通创业板指数 A/B	3,139,542.27	0.3080%
	融通创业板指数 C	0.00	0.0000%
	合计	3,139,542.27	0.3079%

### 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	融通创业板指数 A/B	10~50
	融通创业板指数 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	融通创业板指数 A/B	0~10
	融通创业板指数 C	0
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通创业板指数 A/B	融通创业板指数 C
基金合同生效日（2012年4月6日）基金份额总额	487,321,720.94	-
本报告期期初基金份额总额	583,023,533.66	651,209.27
本报告期基金总申购份额	782,313,355.58	318,066.90
减：本报告期基金总赎回份额	345,920,047.99	728,379.53
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,019,416,841.25	240,896.64

## § 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

#### (1) 基金管理人的重大变动

2018年7月28日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第六届董事会第五次临时会议审议并通过，同意刘晓玲女士辞去公司副总经理职务。

#### (2) 本报告期基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期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

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	
长江证券	1	363,100,089.12	56.67%	330,893.72	56.67%	-
中泰证券	2	120,810,022.91	18.85%	110,094.46	18.85%	-
中金公司	1	114,184,816.46	17.82%	104,056.79	17.82%	-
天风证券	1	42,685,104.86	6.66%	38,898.62	6.66%	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
中信证券（山东）	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

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

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；

- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的  
需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

(6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

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

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

### 3、交易单元变更情况

本报告期内，本基金新增西部证券交易单元，中信万通证券名称变更为中信证券（山东）。

## 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
长江证券	2,708,612.67	8.29%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
中信证券（山东）	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

东兴证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	29,979,106.80	91.71%	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 影响投资者决策的其他重要信息

(1) 根据 2016 年 12 月 25 日财政部、国家税务总局联合下发的《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〔2016〕140 号）、2017 年 1 月 10 日财政部、国家税务总局联合下发的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税〔2017〕2 号）及财政部 2017 年 6 月 30 日发布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税〔2017〕56 号）的通知，现明确自 2018 年 1 月 1 日起，基金管理人运营公募基金及资管产品（以下简称“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。

自 2018 年 1 月 1 日（含）起，本基金管理人将对旗下存续及新增产品发生的增值税应税行为按照相关规定以及税务机关的要求计算和缴纳增值税税款及附加税费。前述税款及附加税费是产品管理、运作和处分过程中发生的，将由产品资产承担，从产品资产中提取缴纳，可能对产品收益水平有所影响，敬请广大投资者知悉。

(2) 根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的要求，本基金管理人经与基金托管人协商一致，对本基金合同进行了修订和更新。本次修订和更新仅涉及与《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》相关的条款，包括前言、释义、基金份额的申购与赎回、基金的投资、基金资产估值、基金的信息披露等，具体内容详见 2018 年 3 月 22 日基金管理人网站披露的相关公告和修订更新后的法律文件。

### 11.2 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

投 资	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
--------	----------------	------------

者类别	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018-6-19~2018-6-30	0.00	269,920,308.49	0.00	269,920,308.49	26.47%
个人							
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能存在因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金单位份额净值剧烈波动的风险及流动性风险。							

融通基金管理有限公司

2018 年 8 月 27 日