

融通跨界成长灵活配置混合型证券投资基金

2018 年半年度报告

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据融通跨界成长灵活配置混合型证券投资基金合同规定，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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
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.....	10
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	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.....	12
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.....	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 所有者权益（基金净值）变动表.....	14

6.4 报表附注.....	15
§ 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.....	32
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.....	33
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	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.....	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.....	37
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.....	37
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.....	37
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	37
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	37
7.12 投资组合报告附注.....	38
§ 8 基金份额持有人信息.....	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	38
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.....	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.....	39
10.4 基金投资策略的改变.....	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	39
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.....	41
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	42
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.....	42

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	42
§ 12 备查文件目录.....	43
12.1 备查文件目录.....	43
12.2 存放地点.....	43
12.3 查阅方式.....	43

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	融通跨界成长灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	融通跨界成长灵活配置混合
基金主代码	001830
前端交易代码	001830
后端交易代码	001831
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 9 月 30 日
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	40,461,317.00 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于进行跨界发展的公司，在合理控制投资风险的基础上，力争把握该类型公司的投资机会，获取基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究，基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例，规避系统性风险。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中债综合全价（总值）指数收益率×50%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。

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
注册地址		深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518053	100140
法定代表人		高峰	易会满

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	融通基金管理有限公司	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 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(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2,266,672.14
本期利润	-930,694.38
加权平均基金份额本期利润	-0.0227
本期加权平均净值利润率	-1.88%
本期基金份额净值增长率	-2.11%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	4,506,486.52
期末可供分配基金份额利润	0.1114
期末基金资产净值	46,982,984.88
期末基金份额净值	1.161
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	16.10%

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

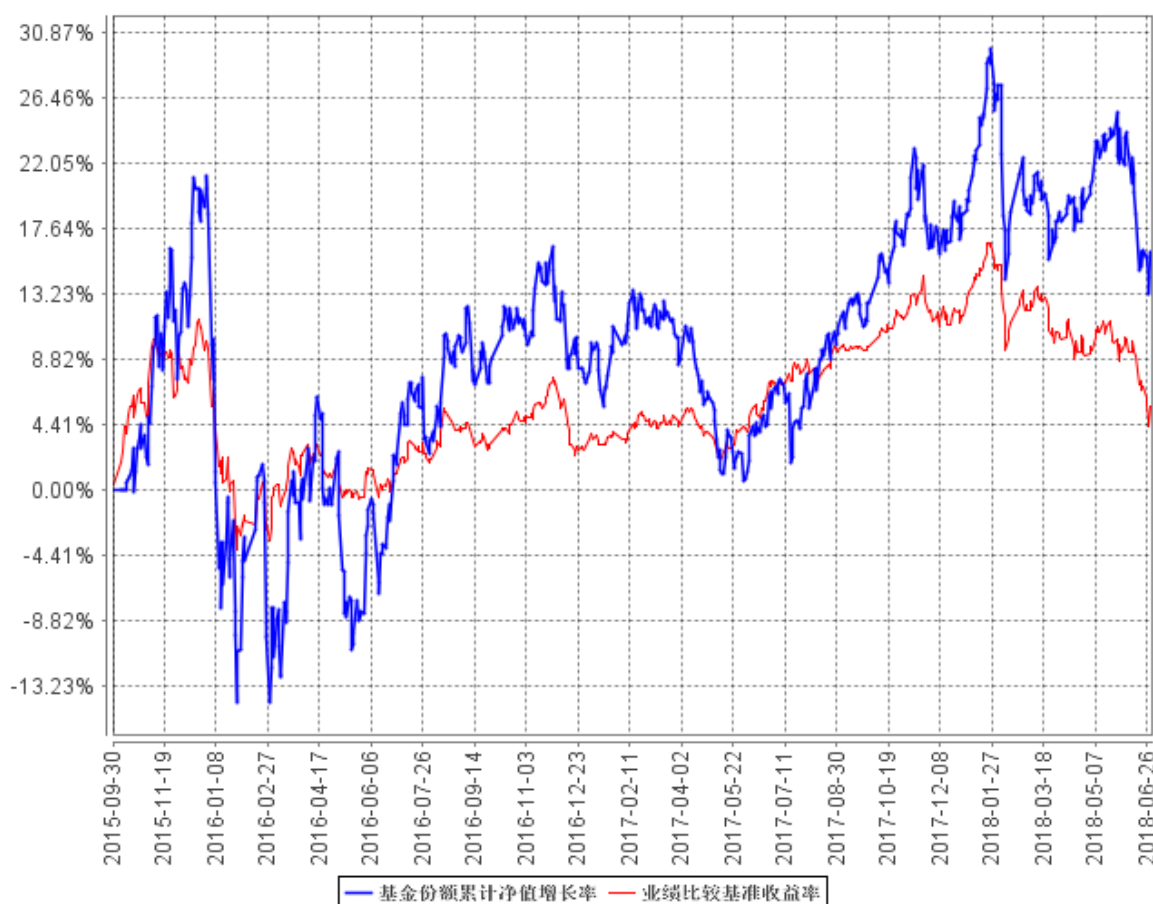
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-6.67%	1.28%	-3.70%	0.64%	-2.97%	0.64%
过去三个月	-1.69%	1.02%	-4.52%	0.57%	2.83%	0.45%
过去六个月	-2.11%	1.09%	-5.47%	0.57%	3.36%	0.52%
过去一年	8.61%	1.01%	-1.46%	0.47%	10.07%	0.54%
自基金合同生效起至今	16.10%	1.50%	5.73%	0.58%	10.37%	0.92%

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



§ 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		
关山	本基金的基金经理、研究部副总监	2017 年 12 月 5 日	-	12	关山女士，英国帝国理工大学金融学硕士、英国伯明翰大学经济学学士，12 年证券投资从业经历，具有基金从业资格，现任融通基金管理有限公司研究部副总监。2006 年 3 月加入融通基金，历任纺织服装、餐饮旅游行业研究员、轻工制造行业研究员、消费组组长。现任融通新消费灵活配置混合、融通跨界成长灵活配置混合、融通红利机会主题精选灵活配置混合基金的基金经理。

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的工作时间为计算标准。

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

2018 年 1 季度整个宏观经济处于比较平稳的状态，虽然有春节因素使得月度数据出现一定波动，但是整体运行状态符合市场前期的预测。基金整体的配置聚焦大众消费品，同时兼顾金融地产及其他板块。春节过后，市场风格比较活跃，政策暖风频吹，很多新经济代表的成长股出现不错的表现。

2018 年 2 季度整个市场出现较多的信息扰动，国内因为去杠杆等监管政策，M2, 社融，基建投资等数据明显走弱；海外受贸易战持续升级，美联储加息美元升值等影响，市场整体走势波幅较大。进入 2 季度，A 股市场避险情绪明显增强，以医药和大众消费品为代表的防御类资产走出明显的结构性行情。基金配置仍主要聚焦增长相对稳定的消费品，同时在二季度增加了医药及成长股的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.161 元；本报告期基金份额净值增长率为-2.11%，业绩比较基准收益率为-5.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在当前时点，市场对下半年经济预期分歧较大，主要集中在政策的底线思维，经济是否仍

具韧性及贸易战后续的演绎。目前也正值上市公司逐步发布半年报的时点，业绩增速的变化也将影响市场对后续行业及公司基本面的判断。我们认为，市场情绪的变化仍将大于经济基本面的变化，我们也希望努力筛选出更多稳健并且符合产业发展趋势的标的。

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及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

本基金本报告期末未进行利润分配，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

从 2017 年 12 月 15 日至 2018 年 1 月 25 日，本基金存在连续二十个工作日以上基金资产净值低于五千万的情形。

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§ 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跨界成长灵活配置混合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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，融通跨界成长灵活配置混合型证券投资基金的管理人——融通基金管理有限公司在融通跨界成长灵活配置混合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，融通跨界成长灵活配置混合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跨界成长灵活配置混合型证券投资基金 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：融通跨界成长灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	17,352,642.82	9,340,018.09
结算备付金		256,988.45	269,003.23
存出保证金		37,623.96	56,563.84
交易性金融资产	6.4.7.2	30,491,204.07	40,401,966.94
其中：股票投资		30,491,204.07	40,401,966.94
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	3,300.15	2,023.13
应收股利		-	-
应收申购款		13,714.20	22,563.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-

资产总计		48,155,473.65	50,092,138.31
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017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		937,243.78	490,339.47
应付赎回款		11,660.95	64,102.77
应付管理人报酬		59,710.47	62,839.27
应付托管费		9,951.75	10,473.19
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	109,290.84	162,653.53
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	44,630.98	120,156.10
负债合计		1,172,488.77	910,564.33
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	40,461,317.00	41,480,933.62
未分配利润	6.4.7.10	6,521,667.88	7,700,640.36
所有者权益合计		46,982,984.88	49,181,573.98
负债和所有者权益总计		48,155,473.65	50,092,138.31

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.161 元，基金份额总额 40,461,317.00 份。

6.2 利润表

会计主体：融通跨界成长灵活配置混合型证券投资基金

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	附注号	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
一、收入		-105,772.94	344,529.43
1. 利息收入		48,385.94	31,763.26
其中：存款利息收入	6.4.7.11	48,385.94	26,984.64
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		-	4,778.62

其他利息收入		-	-
2. 投资收益		3,021,328.79	-281,391.71
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,656,556.94	-702,581.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
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	364,771.85	421,190.15
3. 公允价值变动收益	6.4.7.17	-3,197,366.52	543,692.01
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	6.4.7.18	21,878.85	50,465.87
减：二、费用		824,921.44	1,481,360.05
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	367,981.00	662,706.82
2. 托管费	6.4.10.2.2	61,330.16	110,451.19
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	341,762.30	634,732.90
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	53,847.98	73,469.14
三、利润总额		-930,694.38	-1,136,830.62
减：所得税费用		-	-
四、净利润		-930,694.38	-1,136,830.62

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通跨界成长灵活配置混合型证券投资基金

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）	41,480,933.62	7,700,640.36	49,181,573.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-930,694.38	-930,694.38
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,019,616.62	-248,278.10	-1,267,894.72
其中：1. 基金申购款	9,654,506.47	2,050,061.83	11,704,568.30

2. 基金赎回款	-10,674,123.09	-2,298,339.93	-12,972,463.02
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)	40,461,317.00	6,521,667.88	46,982,984.88
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)	89,023,258.21	6,514,036.97	95,537,295.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,136,830.62	-1,136,830.62
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-28,484,349.59	-1,176,845.19	-29,661,194.78
其中：1. 基金申购款	9,632,454.87	920,019.43	10,552,474.30
2. 基金赎回款	-38,116,804.46	-2,096,864.62	-40,213,669.08
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)	60,538,908.62	4,200,361.16	64,739,269.78

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>张帆</u>	<u>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

融通跨界成长灵活配置混合型证券投资基金(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]1821号《关于准予融通跨界成长灵活配置混合型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《融通跨界成长灵活配置混合型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300,806,363.72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1149号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《融通跨界成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年9月30

日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 300,841,431.29 份基金份额，其中认购资金利息折合 35,067.57 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《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通跨界成长灵活配置混合型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、创业板以及其他经中国证监会批准发行上市的股票)、固定收益类资产(国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、资产支持证券、质押及买断式债券回购、银行存款及现金等)、衍生工具(权证、股指期货等)以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。本基金投资组合中，股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金投资于跨界成长主题相关上市公司的证券资产的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 x50% + 中债综合全价(总值)指数收益率 x50%。

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》、《融通跨界成长灵活配置混合型证券投资基金 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

本基金的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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 6 月 30 日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[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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的

适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
活期存款	17,352,642.82
定期存款	-
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	-
合计	17,352,642.82

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	30,557,307.15	30,491,204.07	-66,103.08
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	30,557,307.15	30,491,204.07	-66,103.08

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末各项买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从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 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,180.90
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	104.04
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
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	15.21
合计	3,300.15

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	109,290.84
银行间市场应付交易费用	-
合计	109,290.84

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	44,630.98
合计	44,630.98

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	41,480,933.62	41,480,933.62
本期申购	9,654,506.47	9,654,506.47
本期赎回(以“-”号填列)	-10,674,123.09	-10,674,123.09
本期末	40,461,317.00	40,461,317.00

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	2,349,176.81	5,351,463.55	7,700,640.36
本期利润	2,266,672.14	-3,197,366.52	-930,694.38
本期基金份额交易产生的变动数	-109,362.43	-138,915.67	-248,278.10
其中：基金申购款	920,269.16	1,129,792.67	2,050,061.83
基金赎回款	-1,029,631.59	-1,268,708.34	-2,298,339.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,506,486.52	2,015,181.36	6,521,667.88

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	46,417.19
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	1,601.87
其他	366.88
合计	48,385.94

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	116,533,388.64
减：卖出股票成本总额	113,876,831.70
买卖股票差价收入	2,656,556.94

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益/损失。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益/损失。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益/损失。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	364,771.85
基金投资产生的股利收益	-
合计	364,771.85

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-3,197,366.52
——股票投资	-3,197,366.52
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-3,197,366.52

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	20,879.43
转换费收入	999.42
合计	21,878.85

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

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

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	341,762.30
银行间市场交易费用	-
合计	341,762.30

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	24,795.19
银行费用	217.00
帐户维护费	9,000.00
合计	53,847.98

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
新时代证券	44,148,569.40	19.74%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
新时代证券	41,116.18	20.11%	41,116.18	37.62%
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			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
新时代证券	-	-	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 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
当期发生的基金应支付	367,981.00	662,706.82

的管理费		
其中：支付销售机构的客户维护费	151,472.10	267,979.34

注：1、支付基金管理人融通基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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	61,330.16	110,451.19

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 0.25% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未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

份额单位：份

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
基金合同生效日（2015年9月30日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	2,555,366.27	-
期间申购/买入总份额	5,796,951.69	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	8,352,317.96	-

期末持有的基金份额 占基金总份额比例	20.64%	-
-----------------------	--------	---

注：基金管理人融通基金在本年度申购本基金的交易通过融通基金网上直销汇款交易方式办理，适用费率为零。

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。

6.4.10.5 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		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	
	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	17,352,642.82	46,417.19	4,154,039.90	23,126.89

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 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均未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末（2018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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金是混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

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

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

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

风险管理部对公司风险管理承担独立评估、监控、检查和报告职责，负责执行公司的风险管理战略和决策，拟定公司风险管理制度，并协同各业务部门制定风险管理流程、评估指标；对风

险进行定性和定量评估，改进风险管理方法、技术和模型，组织推动建立、持续优化风险管理信息系统；对新产品、新业务进行独立监测和评估，提出风险防范和控制建议；负责督促相关部门落实风险管理委员会的各项决策和 risk 管理制度，并对风险管理决策和 risk 管理制度执行情况进行检查、评估和报告。

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，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。

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 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资 (2017 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2018 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

6.4.13.3.1 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》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%（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该比例限制），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%。

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。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%。

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。

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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	17,352,642.82	-	-	-	17,352,642.82
结算备付金	256,988.45	-	-	-	256,988.45
存出保证金	37,623.96	-	-	-	37,623.96
交易性金融资产	-	-	-	30,491,204.07	30,491,204.07
应收利息	-	-	-	3,300.15	3,300.15
应收申购款	-	-	-	13,714.20	13,714.20
资产总计	17,647,255.23	-	-	30,508,218.42	48,155,473.65
负债					
应付证券清算款	-	-	-	937,243.78	937,243.78
应付赎回款	-	-	-	11,660.95	11,660.95
应付管理人报酬	-	-	-	59,710.47	59,710.47
应付托管费	-	-	-	9,951.75	9,951.75
应付交易费用	-	-	-	109,290.84	109,290.84
其他负债	-	-	-	44,630.98	44,630.98
负债总计	-	-	-	1,172,488.77	1,172,488.77
利率敏感度缺口	17,647,255.23	-	-	-29,335,729.65	46,982,984.88
上年度末 2017年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	9,340,018.09	-	-	-	9,340,018.09
结算备付金	269,003.23	-	-	-	269,003.23
存出保证金	56,563.84	-	-	-	56,563.84
交易性金融资产	-	-	-	40,401,966.94	40,401,966.94

应收利息	-	-	-	2,023.13	2,023.13
应收申购款	-	-	-	22,563.08	22,563.08
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	9,665,585.16	-	-	40,426,553.15	50,092,138.31
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	490,339.47	490,339.47
应付赎回款	-	-	-	64,102.77	64,102.77
应付管理人报酬	-	-	-	62,839.27	62,839.27
应付托管费	-	-	-	10,473.19	10,473.19
应付交易费用	-	-	-	162,653.53	162,653.53
其他负债	-	-	-	120,156.10	120,156.10
负债总计	-	-	-	910,564.33	910,564.33
利率敏感度缺口	9,665,585.16	-	-	-39,515,988.82	49,181,573.98

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 2018 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(2017 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净

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 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	30,491,204.07	64.90	40,401,966.94	82.15
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	30,491,204.07	64.90	40,401,966.94	82.15

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数收益率上升 5%	1,887,569.69	2,335,939.71
沪深 300 指数收益率下降 5%	-1,887,569.69	-2,335,939.71	

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	30,491,204.07	63.32
	其中：股票	30,491,204.07	63.32
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	17,609,631.27	36.57
7	其他各项资产	54,638.31	0.11
8	合计	48,155,473.65	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	847,656.00	1.80
B	采矿业	1,894,431.00	4.03
C	制造业	17,262,053.31	36.74
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	1,336,610.00	2.84
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	953,568.00	2.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,879,904.00	8.26
J	金融业	808,085.76	1.72
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,026,046.00	4.31
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	1,482,850.00	3.16
S	综合	-	-
	合计	30,491,204.07	64.90

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

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	300178	腾邦国际	144,100	2,026,046.00	4.31
2	600028	中国石化	291,900	1,894,431.00	4.03
3	000651	格力电器	39,000	1,838,850.00	3.91
4	300630	普利制药	23,900	1,735,140.00	3.69
5	300144	宋城演艺	63,100	1,482,850.00	3.16

6	002410	广联达	53,400	1,480,782.00	3.15
7	600276	恒瑞医药	18,549	1,405,272.24	2.99
8	002832	比音勒芬	37,946	1,404,002.00	2.99
9	000538	云南白药	12,800	1,369,088.00	2.91
10	002327	富安娜	121,100	1,312,724.00	2.79
11	002032	苏泊尔	22,978	1,183,367.00	2.52
12	600600	青岛啤酒	22,815	999,981.45	2.13
13	002087	新野纺织	219,400	985,106.00	2.10
14	600271	航天信息	38,200	965,314.00	2.05
15	600754	锦江股份	25,800	953,568.00	2.03
16	600585	海螺水泥	28,100	940,788.00	2.00
17	600887	伊利股份	33,400	931,860.00	1.98
18	600398	海澜之家	72,263	920,630.62	1.96
19	300253	卫宁健康	74,300	920,577.00	1.96
20	000860	顺鑫农业	23,600	885,000.00	1.88
21	002234	民和股份	73,200	847,656.00	1.80
22	600030	中信证券	48,768	808,085.76	1.72
23	002419	天虹股份	49,300	719,780.00	1.53
24	600859	王府井	29,000	616,830.00	1.31
25	600845	宝信软件	19,400	511,190.00	1.09
26	300166	东方国信	33,600	494,928.00	1.05
27	300365	恒华科技	22,900	472,427.00	1.01
28	300138	晨光生物	54,600	384,930.00	0.82

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	000651	格力电器	3,929,444.00	7.99
2	000860	顺鑫农业	3,186,641.00	6.48
3	601998	中信银行	2,751,437.00	5.59
4	002117	东港股份	2,552,496.00	5.19
5	002640	跨境通	2,521,315.00	5.13
6	600048	保利地产	2,269,453.00	4.61
7	300178	腾邦国际	2,248,063.45	4.57
8	601988	中国银行	2,166,622.00	4.41
9	601601	中国太保	2,018,753.00	4.10

10	600028	中国石化	2,006,041.00	4.08
11	600507	方大特钢	1,957,400.00	3.98
12	600585	海螺水泥	1,739,603.00	3.54
13	601933	永辉超市	1,715,552.00	3.49
14	002032	苏泊尔	1,703,038.00	3.46
15	000888	峨眉山A	1,673,890.00	3.40
16	600398	海澜之家	1,550,398.00	3.15
17	601818	光大银行	1,514,033.00	3.08
18	002087	新野纺织	1,510,707.00	3.07
19	300144	宋城演艺	1,497,230.00	3.04
20	000538	云南白药	1,497,199.10	3.04
21	002557	洽洽食品	1,496,012.25	3.04
22	002410	广联达	1,494,835.00	3.04
23	600436	片仔癀	1,478,372.00	3.01
24	603365	水星家纺	1,474,729.00	3.00
25	002234	民和股份	1,468,429.00	2.99
26	002832	比音勒芬	1,464,533.00	2.98
27	600600	青岛啤酒	1,448,791.00	2.95
28	002327	富安娜	1,403,369.75	2.85
29	600329	中新药业	1,276,602.00	2.60
30	600409	三友化工	1,252,544.00	2.55
31	002304	洋河股份	1,238,583.00	2.52
32	600535	天士力	1,238,492.00	2.52
33	000725	京东方A	1,230,551.00	2.50
34	601288	农业银行	1,223,685.00	2.49
35	002236	大华股份	1,045,796.00	2.13
36	002555	三七互娱	1,039,826.00	2.11
37	600104	上汽集团	1,038,006.00	2.11
38	603877	太平鸟	1,028,738.00	2.09
39	601009	南京银行	1,025,366.00	2.08
40	002419	天虹股份	1,020,042.00	2.07
41	002035	华帝股份	1,019,975.00	2.07
42	600138	中青旅	1,019,520.00	2.07
43	600859	王府井	1,016,523.60	2.07
44	002025	航天电器	1,014,173.00	2.06
45	600038	中直股份	1,011,534.00	2.06

46	002511	中顺洁柔	1,009,151.40	2.05
47	300253	卫宁健康	1,008,957.90	2.05
48	000977	浪潮信息	1,006,062.00	2.05
49	600271	航天信息	1,004,581.00	2.04
50	600612	老凤祥	1,001,743.00	2.04
51	601339	百隆东方	1,001,093.00	2.04
52	600754	锦江股份	1,001,071.00	2.04
53	000002	万科A	999,792.00	2.03
54	300338	开元股份	998,458.00	2.03
55	000568	泸州老窖	998,064.00	2.03
56	600623	华谊集团	997,049.17	2.03
57	002138	顺络电子	990,465.00	2.01
58	002027	分众传媒	986,630.00	2.01
59	000717	韶钢松山	986,034.00	2.00
60	002013	中航机电	985,695.00	2.00
61	000768	中航飞机	984,929.00	2.00
62	600029	南方航空	984,846.00	2.00
63	601111	中国国航	984,466.00	2.00

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600887	伊利股份	4,096,242.57	8.33
2	601336	新华保险	3,160,923.82	6.43
3	601111	中国国航	3,097,305.63	6.30
4	601601	中国太保	2,897,459.51	5.89
5	601288	农业银行	2,693,991.06	5.48
6	000860	顺鑫农业	2,667,250.00	5.42
7	601998	中信银行	2,648,905.15	5.39
8	002117	东港股份	2,568,339.70	5.22
9	002640	跨境通	2,410,847.96	4.90
10	600436	片仔癀	2,386,193.00	4.85
11	601939	建设银行	2,383,206.49	4.85
12	600507	方大特钢	2,296,509.38	4.67
13	600048	保利地产	2,151,088.46	4.37

14	600521	华海药业	2,026,713.70	4.12
15	002299	圣农发展	2,009,450.70	4.09
16	601988	中国银行	1,970,048.14	4.01
17	000651	格力电器	1,957,418.15	3.98
18	600029	南方航空	1,944,029.94	3.95
19	601888	中国国旅	1,790,439.76	3.64
20	601933	永辉超市	1,645,807.09	3.35
21	000888	峨眉山A	1,636,143.61	3.33
22	600019	宝钢股份	1,635,860.00	3.33
23	601155	新城控股	1,606,863.26	3.27
24	600115	东方航空	1,559,379.00	3.17
25	603365	水星家纺	1,552,561.76	3.16
26	000895	双汇发展	1,550,975.88	3.15
27	603883	老百姓	1,520,085.62	3.09
28	601818	光大银行	1,468,534.00	2.99
29	002557	洽洽食品	1,448,408.02	2.95
30	600584	长电科技	1,417,595.74	2.88
31	300015	爱尔眼科	1,393,022.54	2.83
32	002304	洋河股份	1,272,300.00	2.59
33	601100	恒立液压	1,222,819.44	2.49
34	600329	中新药业	1,212,518.00	2.47
35	300540	深冷股份	1,199,868.09	2.44
36	000725	京东方A	1,181,904.22	2.40
37	603866	桃李面包	1,169,110.73	2.38
38	002025	航天电器	1,120,368.84	2.28
39	000661	长春高新	1,092,669.00	2.22
40	603708	家家悦	1,083,896.30	2.20
41	600535	天士力	1,056,524.00	2.15
42	600138	中青旅	1,048,936.35	2.13
43	002511	中顺洁柔	1,044,729.00	2.12
44	002138	顺络电子	1,034,050.00	2.10
45	002867	周大生	1,023,995.00	2.08
46	601009	南京银行	1,019,780.00	2.07
47	600030	中信证券	1,012,845.72	2.06
48	600258	首旅酒店	1,011,454.00	2.06
49	603877	太平鸟	1,003,482.00	2.04
50	002027	分众传媒	998,866.00	2.03
51	600038	中直股份	984,650.25	2.00

注：“卖出金额”是指卖出股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	107,163,435.35
卖出股票收入（成交）总额	116,533,388.64

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

在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。若法律法规或监管机构以后允许基金投资如期权、互换等其他金融衍生品种，本基金将以风险管理和组合优化为目的，根据届时法律法规的相关规定参与投资。

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	37,623.96
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,300.15
5	应收申购款	13,714.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	54,638.31

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

本基金本报告期末前十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

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
1,509	26,813.33	8,354,072.26	20.65%	32,107,244.74	79.35%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	9,470.45	0.0234%
------------------	----------	---------

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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年9月30日）基金份额总额	300,841,431.29
本报告期期初基金份额总额	41,480,933.62
本报告期基金总申购份额	9,654,506.47
减：本报告期基金总赎回份额	10,674,123.09
本报告期末基金份额总额	40,461,317.00

§ 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

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。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自基金

合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	
国泰君安	1	61,687,671.64	27.58%	55,321.55	27.05%	-
新时代证券	1	44,148,569.40	19.74%	41,116.18	20.11%	-
光大证券	1	34,948,722.45	15.62%	31,848.69	15.57%	-
恒泰证券	1	32,393,182.88	14.48%	30,166.92	14.75%	-
中泰证券	1	24,971,941.82	11.16%	22,756.30	11.13%	-
天风证券	1	20,499,878.50	9.16%	18,680.56	9.14%	-
中信证券	1	4,064,329.30	1.82%	3,703.79	1.81%	-
东北证券	1	982,528.00	0.44%	895.34	0.44%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
西部证券	3	-	-	-	-	-
西藏东方财富	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
广州证券	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) 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
- 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

本基金本报告期新增西部证券交易单元 1 个，终止租用国联证券交易单元 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	关于中泰证券代销的旗下部分开放式基金开展申 购及定期定额投资业务费率优惠活动的公告	上海证券报、 管理人网站	2018-1-31
2	关于新时代证券代销的旗下部分开放式基金新增 开通定期定额投资业务的公告	上海证券报、 管理人网站	2018-3-13
3	关于修改《融通跨界成长灵活配置混合型证券投资 基金基金合同》部分条款的公告	上海证券报、 管理人网站	2018-3-22
4	融通基金关于新增中证金牛（北京）投资咨询有限 公司为代销机构并开通定期定额投资业务、转换业 务及参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、 管理人网站	2018-3-22
5	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金 参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优 惠活动的公告	上海证券报、 管理人网站	2018-3-30
6	关于融通旗下部分开放式基金参加交通银行手机 银行申购及定期定额投资业务费率优惠活动的公 告	上海证券报、 管理人网站	2018-3-30
7	融通基金关于新增北京蛋卷基金销售有限公司为	上海证券报、	2018-4-16

	代销机构并开通定期定额投资业务、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	管理人网站	
8	融通基金管理有限公司关于新增金惠家保险代理有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、管理人网站	2018-5-14
9	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加中国银河证券股份有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	上海证券报、管理人网站	2018-5-21
10	融通关于旗下部分开放式基金新增蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、管理人网站	2018-6-26
11	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司申购及定期定额投资业务费率优惠活动的公告	上海证券报、管理人网站	2018-6-30

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	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	-	20180403-20180417, 20180419-20180507, 20180515-20180630	2,555,366.27	5,796,951.69	-	8,352,317.96	20.64%
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净值剧烈波动的风险及流动性风险。

11.2 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。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一)《融通跨界成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (二)《融通跨界成长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (三)《融通跨界成长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其定期更新
- (四)中国证监会批准融通跨界成长灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- (五)融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- (六)报告期内在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

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

融通基金管理有限公司

2018 年 8 月 27 日