

融通中国风 1 号灵活配置混合型证券投资基金

2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 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：2019 年 3 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中国风1号灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同规定，于2019年3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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2018年1月1日起至12月31日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	融通中国风1号灵活配置混合
基金主代码	001852
前端交易代码	001852
后端交易代码	001853
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年2月3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	41,142,818.17份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金精选优质上市公司进行投资，分享相关行业、上市公司发展过程中的投资机会，在保证本金安全的前提下，力争实现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) 66105799
	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) 66105798

### 2.4 信息披露方式

登载基金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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2018年	2017年	2016年2月3日(基金合同生效日)-2016年12月31日
本期已实现收益	-3,099,745.79	4,513,938.90	7,177,373.20
本期利润	-10,430,704.95	7,712,827.97	7,791,572.20
加权平均基金份额本期利润	-0.2836	0.1955	0.0890
本期基金份额净值增长率	-22.05%	19.28%	8.32%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0213	0.1976	0.0534
期末基金资产净值	40,264,552.55	50,212,475.14	42,130,554.44
期末基金份额净值	0.979	1.256	1.053

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)。

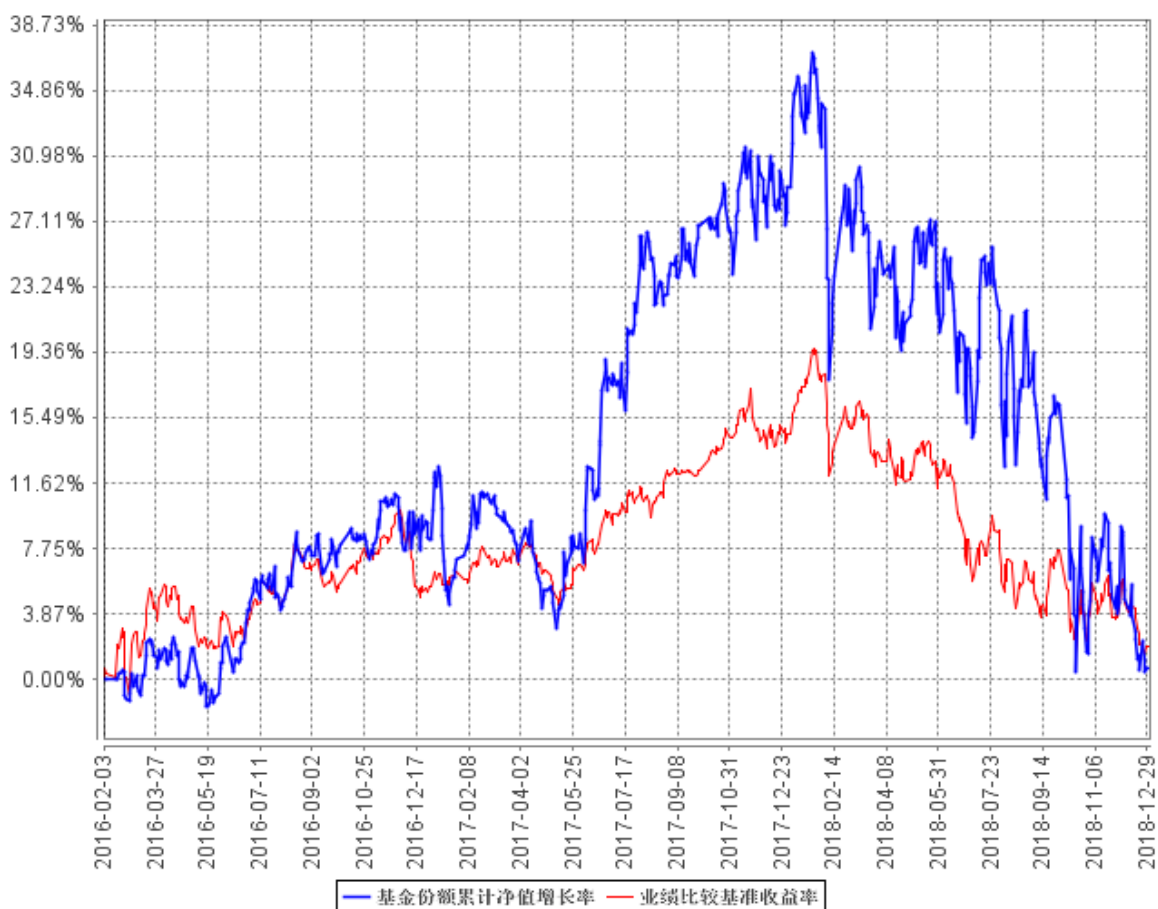
### 3.2 基金净值表现

#### 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
过去三个月	-13.36%	1.73%	-5.31%	0.81%	-8.05%	0.92%
过去六个月	-15.82%	1.64%	-5.87%	0.74%	-9.95%	0.90%
过去一年	-22.05%	1.59%	-11.03%	0.66%	-11.02%	0.93%
自基金合同生效起至今	0.71%	1.12%	1.92%	0.53%	-1.21%	0.59%

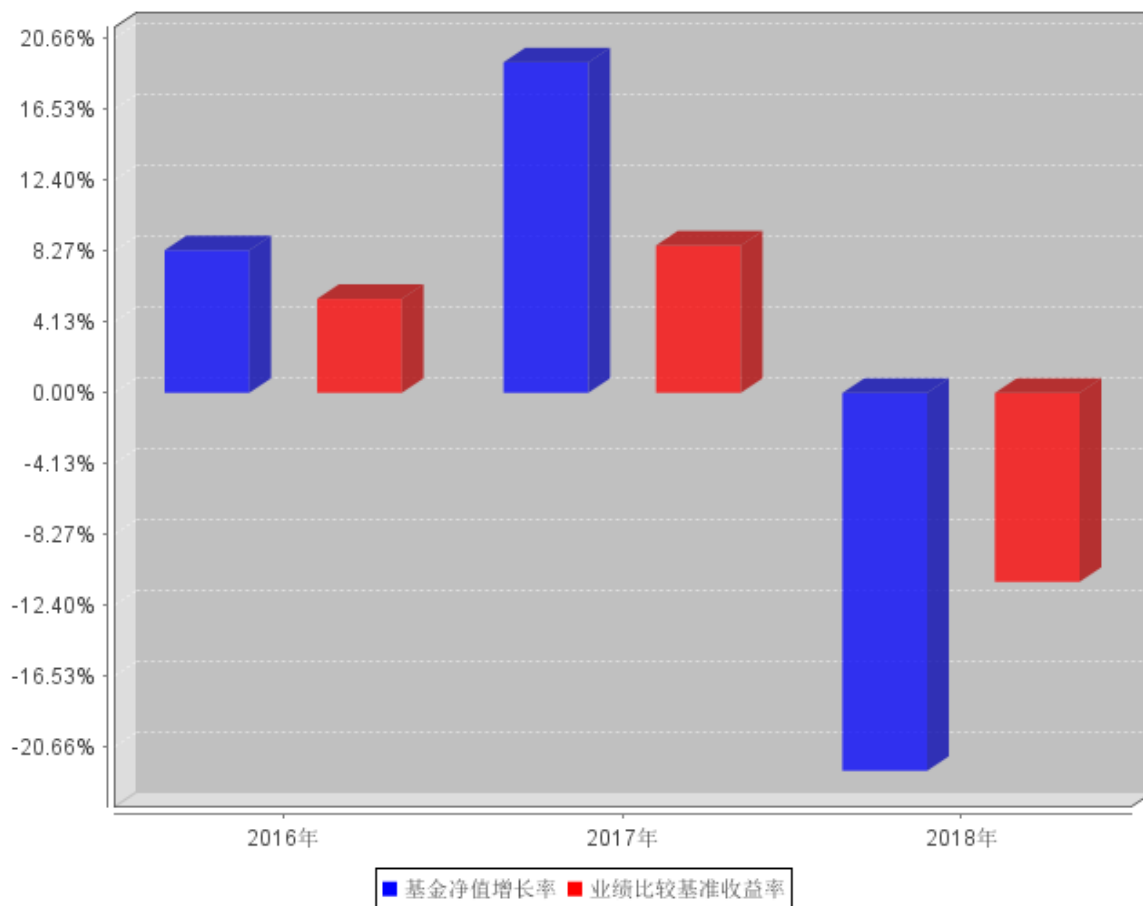
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同生效日为2016年2月3日，合同生效当年按实际存续期计算，未按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2018	-	-	-	-	
2017	-	-	-	-	
2016	0.3000	1,059,342.42	444,232.88	1,503,575.30	
合计	0.3000	1,059,342.42	444,232.88	1,503,575.30	

## § 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 12 月 31 日，公司共管理六十五只开放式基金：即融通新蓝筹证券投资基金、融通债券投资基金、融通蓝筹成长证券投资基金、融通深证 100 指数证券投资基金、融通行业景气证券投资基金、融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF)、融通易支付货币市场证券投资基金、融通动力先锋混合型证券投资基金、融通领先成长混合型证券投资基金 (LOF)、融通内需驱动混合型证券投资基金、融通深证成份指数证券投资基金、融通四季添利债券型证券投资基金 (LOF)、融通创业板指数增强型证券投资基金、融通医疗保健行业混合型证券投资基金、融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金、融通通泰保本混合型证券投资基金、融通通源短融债券型证券投资基金、融通通瑞债券型证券投资基金、融通月月添利定期开放债券型证券投资基金、融通健康产业灵活配置混合型证券投资基金、融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金、融通互联网传媒灵活配置混合型证券投资基金、融通新区新经济灵活配置混合型证券投资基金、融通通鑫灵活配置混合型证券投资基金、融通新能源灵活配置混合型证券投资基金、融通中证军工指数分级证券投资基金、融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金、融通跨界成长灵活配置混合型证券投资基金、融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金、融通成长 30 灵活配置混合型证券投资基金、融通汇财宝货币市场基金、融通中国风 1 号灵活配置混合型证券投资基金、融通通盈保本混合型证券投资基金、融通增利债券型证券投资基金、融通增鑫债券型证券投资基金、融通增益债券型证券投资基金、融通增祥债券型证券投资基金、融通新消费灵活配置混合型证券投资基金、融通通安债券型证券投资基金、融通通优债券型证券投资基金、融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金、融通新趋势灵活配置混合型证券投资基金、融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金、融通通和债券型证券投资基金、融通沪港深智慧生活灵活配置混合型证券投资基金、融通现金宝货币市场基金、融通通祺债券型证券投资基金、融通可转债债券型证券投资基金、融通通福债券型证券投资基金 (LOF)、融通通宸债券型证券投资基金、融通通玺债券型证券投资基金、融通通润债券型证券投资基金、融通中证人工智能主题指数证券投资基金 (LOF)、融通收益增强债券型证券投资基金、融通中国概念债券型证券投资基金 (QDII)、融通逆向策略灵活配置混合型证券投资基金、融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金、融通红利机会主题精选灵活配置混合型证券投资基金、融通通昊定期开放债券型发起式证券投资基金、融通新能源汽车主题精选灵活配置混合型证券投资基金、融通增辉定期开放债券型发起式证券投资基金、融通增悦债券型证券投资基金、融通通捷债券型证券投资基金、融通研究优选混合型证券投资基金、融通丰利四分法证券投资基金 (QDII)。其中，融通债券投资基金、融通深证 100 指数证券投资基金和融通蓝筹成长证券投资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		
范琨	本基金的基金经理	2016年2月5日	-	6	范琨女士，复旦大学金融学硕士、湖南大学化学工程学士，6年证券投资从业经历，具有基金从业资格。2012年7月加入融通基金管理有限公司，历任化工行业研究员、周期组组长。现任融通中国风1号灵活配置混合、融通新区域新经济灵活配置混合基金的基金经理。
彭炜	本基金的基金经理	2017年8月5日	-	6	彭炜先生，上海交通大学管理学硕士、工学学士，6年证券投资从业经历，具有基金从业资格。2012年4月加入融通基金，历任建筑建材、房地产、钢铁煤炭行业研究员，周期行业组长。现任融通中国风1号灵活配置混合、融通国企改革新机遇灵活配置混合、融通新区域新经济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 公平交易制度和控制方法

为了保证旗下的不同投资组合得到公平对待，本基金管理人制定了《融通基金管理有限公司公平交易制度》，公平交易制度所规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，并涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

本基金管理人通过建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段来保证公平交易原则的实现。同时，本基金管理人通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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A股市场呈现了整体单边下跌的行情，其中上证综指下跌24.59%，沪深300指数下跌25.31%，创业板指下跌28.65%。行业结构层面，本基金在上半年积极挖掘中观细分行业的景气度与产业趋势，较好地把握住了以创新药、旅游、食品饮料、云计算、和部分周期投资品等行业的结构性机会。然而下半年随着去杠杆对经济压力的进一步凸显，以及中美贸易摩擦的持续升级，再加上以医药行业为代表的“带量采购”政策等因素影响，市场整体风险偏好出现大幅下降，致使上半年偏强势的板块亦进入熊市氛围偏后期的补跌阶段。由于考虑到当时市场整体估值已处于较低水平，本基金的仓位维持略高，故导致组合的相对收益在下半年有一定程度的收敛。

##### 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0.979元；本报告期基金份额净值增长率为-22.05%，业绩比较基准收益率为-11.03%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2019年，国内宏观经济的下行压力依然存在，最新的中央经济工作会议继续释放出稳增长、稳就业等积极的政策信号，包括关于中美贸易关系90天谈判内容的乐观推进。因此，我们认为，在政府逆周期调节政策的积极推进过程中，伴随货币向信用的传导机制疏通等实质性措施的有效落地，国内经济有望在年中逐步见底企稳。对应到证券市场，预计指数进一步下行空间有限，从而应更加注重不同阶段的结构性机会。结合相应的投资时钟，组合的配置将由年初以新基建/科技基建等逆周期政策调节的板块逐步随着经济前瞻指标的企稳而过渡到以房地产/汽车及相关产业链等早周期的板块；另外，在经历了2018年的系统性杀估值后，不少细分行业的优质成长股



也将成为本基金组合重点挖掘、积极配置的主要领域。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

截至本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签订服务协议，由其提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金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

截止本报告期末，本基金存在连续六十个工作日以上基金资产净值低于五千万的情形。本基金管理人已经按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》向中国证监会报告并提出解决方案。

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中国风1号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，融通中国风1号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

公司在融通中国风1号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，融通中国风1号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中国风1号灵活配置混合型证券投资基金2018年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 审计报告

本基金2018年年度财务会计报告已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告（普华永道中天审字(2019)第21142号），投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：融通中国风1号灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	13,703,662.24	4,552,349.73
结算备付金	71,897.10	74,634.56
存出保证金	12,110.35	91,584.15
交易性金融资产	26,931,734.58	45,735,551.00
其中：股票投资	26,931,734.58	45,735,551.00
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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	2,805.42	896.91
应收股利	-	-
应收申购款	3,593.93	2,110.52
递延所得税资产	-	-

其他资产	-	-
资产总计	40,725,803.62	50,457,126.87
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2018年12月31日</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	-	-
应付赎回款	326,807.20	78,627.23
应付管理人报酬	53,854.58	62,909.48
应付托管费	8,975.78	10,484.94
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	27,023.86	42,480.19
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	44,589.65	50,149.89
负债合计	461,251.07	244,651.73
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	41,142,818.17	39,967,199.26
未分配利润	-878,265.62	10,245,275.88
所有者权益合计	40,264,552.55	50,212,475.14
负债和所有者权益总计	40,725,803.62	50,457,126.87

注：报告截止日2018年12月31日，基金份额净值0.979元，基金份额总额41,142,818.17份。

## 7.2 利润表

会计主体：融通中国风1号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12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017 年12月31日
<b>一、收入</b>	-9,080,799.08	9,633,384.41
1. 利息收入	76,884.35	114,325.44
其中：存款利息收入	53,550.58	87,734.59
债券利息收入	15.76	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	23,318.01	26,590.85

其他利息收入	-	-
2. 投资收益	-2,057,459.23	5,994,500.83
其中：股票投资收益	-2,437,514.88	5,776,941.31
基金投资收益	-	-
债券投资收益	9,132.11	-
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	370,923.54	217,559.52
3. 公允价值变动收益	-7,330,959.16	3,198,889.07
4. 汇兑收益	-	-
5. 其他收入	230,734.96	325,669.07
<b>减：二、费用</b>	<b>1,349,905.87</b>	<b>1,920,556.44</b>
1. 管理人报酬	640,513.80	674,860.65
2. 托管费	106,752.38	112,476.81
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	459,837.63	1,014,800.98
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	0.06	-
7. 其他费用	142,802.00	118,418.00
<b>三、利润总额</b>	<b>-10,430,704.95</b>	<b>7,712,827.97</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润</b>	<b>-10,430,704.95</b>	<b>7,712,827.97</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通中国风1号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12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31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）	39,967,199.26	10,245,275.88	50,212,475.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-10,430,704.95	-10,430,704.95
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	1,175,618.91	-692,836.55	482,782.36
其中：1. 基金申购款	40,037,915.13	4,956,581.46	44,994,496.59

2. 基金赎回款	-38,862,296.22	-5,649,418.01	-44,511,714.23
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）	41,142,818.17	-878,265.62	40,264,552.55
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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）	39,996,447.90	2,134,106.54	42,130,554.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,712,827.97	7,712,827.97
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-29,248.64	398,341.37	369,092.73
其中：1. 基金申购款	65,370,783.79	9,850,044.01	75,220,827.80
2. 基金赎回款	-65,400,032.43	-9,451,702.64	-74,851,735.07
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）	39,967,199.26	10,245,275.88	50,212,475.14

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

#### 7.4 报表附注

##### 7.4.1 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

###### 7.4.1.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

###### 7.4.1.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.2 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。

#### 7.4.3 关联方关系

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
日兴资产管理有限公司	基金管理人的股东
深圳市融通资本管理股份有限公司	基金管理人的子公司
融通国际资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

#### 7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.4.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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	10,132,618.50	3.34%	13,652,501.28	2.02%

##### 7.4.4.1.2 权证交易

无。

##### 7.4.4.1.3 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12月31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	9,436.64	3.41%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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	12,714.65	2.05%	-	-

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。

#### 7.4.4.2 关联方报酬

##### 7.4.4.2.1 基金管理费

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12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	640,513.80	674,860.65
其中：支付销售机构的客户维护费	175,103.84	242,850.63

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：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/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。

##### 7.4.4.2.2 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12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	106,752.38	112,476.81

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：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

##### 7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 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12月31日	2017年1月1日至 2017年12月31日
报告期初持有的基金份额	7,929,605.48	-
报告期间申购/买入总份额		7,929,605.48
报告期间因拆分变动份额		-
减：报告期间赎回/卖出总份额		-
报告期末持有的基金份额	7,929,605.48	7,929,605.48
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	19.27%	19.84%

注：基金管理人投资本基金的适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

7.4.4.4.2 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

无。

7.4.4.5 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		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年12月31日		2017年1月1日至2017年12月31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	13,703,662.24	50,980.34	4,552,349.73	81,586.92

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。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.5 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。



## 7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

无。

## 7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

无。

## §8 投资组合报告

## 8.1 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	26,931,734.58	66.13
	其中：股票	26,931,734.58	66.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	13,775,559.34	33.83
8	其他各项资产	18,509.70	0.05
9	合计	40,725,803.62	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

## 8.2.1 报告期末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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,106,366.80	2.75
B	采矿业	-	-
C	制造业	18,356,566.82	45.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,507,890.96	3.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务	2,665,834.00	6.62

	业		
J	金融业		-
K	房地产业		-
L	租赁和商务服务业	2,215,360.00	5.50
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	1,079,716.00	2.68
S	综合		-
	合计	26,931,734.58	66.89

### 8.3 期末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	300630	普利制药	51,236	2,257,458.16	5.61
2	601888	中国国旅	36,800	2,215,360.00	5.50
3	002798	帝欧家居	124,940	1,675,445.40	4.16
4	000661	长春高新	9,300	1,627,500.00	4.04
5	600271	航天信息	69,400	1,588,566.00	3.95
6	601100	恒立液压	78,660	1,558,254.60	3.87
7	002410	广联达	67,400	1,402,594.00	3.48
8	002463	沪电股份	193,000	1,383,810.00	3.44
9	300059	东方财富	104,400	1,263,240.00	3.14
10	603345	安井食品	31,400	1,155,520.00	2.87

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。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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	600697	欧亚集团	3,842,949.00	7.65
2	601888	中国国旅	3,735,982.00	7.44
3	300630	普利制药	3,410,730.25	6.79
4	300170	汉得信息	3,376,154.00	6.72

5	000661	长春高新	3,143,852.00	6.26
6	601100	恒立液压	2,752,086.00	5.48
7	600036	招商银行	2,629,677.00	5.24
8	000717	*ST 韶钢	2,509,655.79	5.00
9	600694	大商股份	2,482,722.00	4.94
10	002798	帝欧家居	2,422,857.00	4.83
11	600801	华新水泥	2,418,521.00	4.82
12	600038	中直股份	2,391,427.00	4.76
13	300377	赢时胜	2,318,994.00	4.62
14	600585	海螺水泥	2,304,161.59	4.59
15	603986	兆易创新	2,271,208.00	4.52
16	600276	恒瑞医药	2,271,092.20	4.52
17	600258	首旅酒店	2,243,034.00	4.47
18	002557	洽洽食品	2,234,639.00	4.45
19	002727	一心堂	2,219,196.00	4.42
20	300253	卫宁健康	2,208,984.86	4.40
21	603019	中科曙光	2,185,336.00	4.35
22	603877	太平鸟	2,183,085.70	4.35
23	600623	华谊集团	1,965,994.00	3.92
24	002410	广联达	1,861,214.00	3.71
25	300059	东方财富	1,739,288.00	3.46
26	600271	航天信息	1,722,631.00	3.43
27	300604	长川科技	1,631,544.00	3.25
28	603345	安井食品	1,558,616.00	3.10
29	600720	祁连山	1,548,905.00	3.08
30	000789	万年青	1,512,968.00	3.01
31	300033	同花顺	1,498,489.00	2.98
32	600588	用友网络	1,487,951.75	2.96
33	600285	羚锐制药	1,484,873.00	2.96
34	000417	合肥百货	1,483,658.00	2.95
35	000501	鄂武商A	1,483,510.00	2.95
36	002083	孚日股份	1,482,912.21	2.95
37	600612	老凤祥	1,477,460.00	2.94
38	601339	百隆东方	1,476,936.00	2.94
39	600280	中央商场	1,474,344.00	2.94
40	002635	安洁科技	1,448,901.00	2.89

41	002293	罗莱生活	1,447,487.00	2.88
42	000543	皖能电力	1,434,948.00	2.86
43	600771	广誉远	1,419,249.00	2.83
44	300383	光环新网	1,415,315.00	2.82
45	600570	恒生电子	1,414,779.00	2.82
46	600521	华海药业	1,407,678.00	2.80
47	002463	沪电股份	1,389,111.00	2.77
48	601899	紫金矿业	1,371,965.00	2.73
49	300146	汤臣倍健	1,344,999.00	2.68
50	600048	保利地产	1,292,624.00	2.57
51	300470	日机密封	1,282,063.00	2.55
52	600029	南方航空	1,274,057.00	2.54
53	601111	中国国航	1,273,939.00	2.54
54	600754	锦江股份	1,271,138.29	2.53
55	002430	杭氧股份	1,241,194.00	2.47
56	000681	视觉中国	1,228,785.00	2.45
57	300122	智飞生物	1,219,233.00	2.43
58	600887	伊利股份	1,201,829.00	2.39
59	600808	马钢股份	1,183,220.00	2.36
60	002110	三钢闽光	1,171,360.00	2.33
61	000799	酒鬼酒	1,155,707.00	2.30
62	002916	深南电路	1,115,073.00	2.22
63	000977	浪潮信息	1,112,528.00	2.22
64	600436	片仔癀	1,106,520.24	2.20
65	300406	九强生物	1,101,513.00	2.19
66	600782	新钢股份	1,100,197.74	2.19
67	000932	华菱钢铁	1,083,266.00	2.16
68	600176	中国巨石	1,083,039.00	2.16
69	600859	王府井	1,033,540.00	2.06
70	300498	温氏股份	1,027,889.00	2.05
71	000537	广宇发展	1,019,925.00	2.03
72	000822	山东海化	1,015,405.00	2.02
73	002321	华英农业	1,006,291.00	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。

#### 8.4.2 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	600801	华新水泥	5,541,992.37	11.04
2	600887	伊利股份	4,159,263.09	8.28
3	600697	欧亚集团	3,566,835.20	7.10
4	000789	万年青	3,422,663.70	6.82
5	300630	普利制药	3,417,906.50	6.81
6	600782	新钢股份	3,334,274.00	6.64
7	300170	汉得信息	3,180,910.00	6.33
8	600176	中国巨石	3,038,371.32	6.05
9	600754	锦江股份	2,862,311.76	5.70
10	000932	华菱钢铁	2,845,120.60	5.67
11	601888	中国国旅	2,760,911.03	5.50
12	002110	三钢闽光	2,587,384.76	5.15
13	300253	卫宁健康	2,556,462.86	5.09
14	600036	招商银行	2,512,353.78	5.00
15	600694	大商股份	2,506,607.95	4.99
16	603986	兆易创新	2,283,028.05	4.55
17	600038	中直股份	2,264,671.81	4.51
18	600622	光大嘉宝	2,230,760.24	4.44
19	600258	首旅酒店	2,169,797.62	4.32
20	603877	太平鸟	2,145,815.68	4.27
21	002557	洽洽食品	2,132,184.00	4.25
22	300377	赢时胜	2,098,537.00	4.18
23	600521	华海药业	2,045,687.11	4.07
24	000717	韶钢松山	2,015,608.00	4.01
25	002727	一心堂	1,897,124.00	3.78
26	601799	星宇股份	1,804,122.90	3.59
27	002294	信立泰	1,731,670.27	3.45
28	600623	华谊集团	1,723,098.00	3.43
29	600809	山西汾酒	1,596,881.31	3.18
30	600285	羚锐制药	1,539,619.00	3.07
31	600276	恒瑞医药	1,519,934.40	3.03
32	600570	恒生电子	1,499,852.00	2.99
33	002635	安洁科技	1,492,381.00	2.97
34	601339	百隆东方	1,395,350.00	2.78
35	002293	罗莱生活	1,388,403.00	2.77
36	600771	广誉远	1,383,008.75	2.75

37	600612	老凤祥	1,382,052.00	2.75
38	002083	孚日股份	1,381,743.56	2.75
39	600280	中央商场	1,376,156.00	2.74
40	000725	京东方A	1,369,271.00	2.73
41	300033	同花顺	1,346,937.00	2.68
42	000417	合肥百货	1,339,095.00	2.67
43	600742	一汽富维	1,337,515.80	2.66
44	600720	祁连山	1,316,268.00	2.62
45	000063	中兴通讯	1,305,330.00	2.60
46	600048	保利地产	1,303,000.00	2.59
47	603883	老百姓	1,299,959.00	2.59
48	600030	中信证券	1,297,179.00	2.58
49	600436	片仔癀	1,293,617.00	2.58
50	000543	皖能电力	1,291,615.00	2.57
51	601899	紫金矿业	1,272,810.00	2.53
52	000501	鄂武商A	1,266,118.98	2.52
53	600029	南方航空	1,251,528.27	2.49
54	600588	用友网络	1,251,364.00	2.49
55	601111	中国国航	1,249,908.55	2.49
56	000661	长春高新	1,242,360.00	2.47
57	300146	汤臣倍健	1,227,399.00	2.44
58	002798	帝欧家居	1,226,329.60	2.44
59	300383	光环新网	1,225,792.00	2.44
60	600406	国电南瑞	1,202,851.77	2.40
61	000568	泸州老窖	1,165,800.00	2.32
62	600808	马钢股份	1,147,311.00	2.28
63	002430	杭氧股份	1,138,667.84	2.27
64	601003	柳钢股份	1,114,702.00	2.22
65	601688	华泰证券	1,085,792.85	2.16
66	600585	海螺水泥	1,071,112.00	2.13
67	601100	恒立液压	1,066,383.00	2.12
68	601566	九牧王	1,049,146.66	2.09
69	000100	TCL 集团	1,042,199.00	2.08
70	300122	智飞生物	1,031,940.00	2.06
71	300406	九强生物	1,009,626.70	2.01

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。

#### 8.4.3 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	147,163,168.02
卖出股票收入（成交）总额	156,198,510.40

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。

#### 8.5 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。

#### 8.6 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。

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 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。

##### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 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。

##### 8.11.2 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。

##### 8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	12,110.35
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,805.42
5	应收申购款	3,593.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,509.70

8.12.4 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。

8.12.5 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
806	51,045.68	13,929,133.25	33.86%	27,213,684.92	66.14%

9.2 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	16,468.08	0.0400%

9.3 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、基金投资和研 究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



## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年2月3日）基金份额总额	265,553,528.17
本报告期期初基金份额总额	39,967,199.26
本报告期期间基金总申购份额	40,037,915.13
减：本报告期基金总赎回份额	38,862,296.22
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	41,142,818.17

## § 11 重大事件揭示

## 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期末召开基金份额持有人大会。

## 11.2 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

## 11.2.1 基金管理人重大人事变动

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。

## 11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动

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。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

在本报告期内没有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金的投资策略未发生变更。

## 11.5 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，本年度应支付的审计费用为40,000.00元。

## 11.6 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，基金管理人、托管人及其高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情形。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 11.7.1 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元数量	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	
天风证券	2	100,398,019.94	33.13%	91,492.72	33.06%	-
东北证券	1	96,910,162.78	31.98%	88,315.77	31.91%	-
长江证券	1	40,324,977.90	13.31%	36,748.08	13.28%	-
西藏东方财富	1	23,253,350.57	7.67%	21,190.79	7.66%	-
恒泰证券	1	13,034,354.09	4.30%	12,138.92	4.39%	-
中泰证券	3	11,293,746.00	3.73%	10,291.72	3.72%	-
新时代证券	1	10,132,618.50	3.34%	9,436.64	3.41%	-
平安证券	2	4,186,433.64	1.38%	3,898.82	1.41%	-
安信证券	2	3,485,139.00	1.15%	3,245.78	1.17%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	3	-	-	-	-	-

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

本报告期内基金新增2个西部证券交易单元。本报告期内基金终止1个国联证券交易单元。

#### 11.7.2 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
天风证券	58,924.40	46.34%	-	-	-	-
东北证券	-	-	13,500,000.00	100.00%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财 富	-	-	-	-	-	-

恒泰证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	68,224.00	53.66%	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

## 12.1 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	1	20180109~20180302, 20180314~20180606,	7,929,605.48	0.00	0.00	7,929,605.48	19.27%

		20180619~20180906, 20180920~20181206					
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。							

## 12.2 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。

融通基金管理有限公司

2019 年 3 月 27 日