

融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)

2019 年半年度报告摘要

2019 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：2019 年 8 月 24 日

§ 1 重要提示

融通领先成长混合型证券投资基金 (LOF) 由原通宝证券投资基金基金转型而来, 转型后的基金合同生效日为 2007 年 4 月 30 日。

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领先成长混合型证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”) 基金合同规定, 于 2019 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 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 | 融通领先成长混合 (LOF) |
| 场内简称 | 融通领先 |
| 基金主代码 | 161610 |
| 前端交易代码 | 161610 |
| 后端交易代码 | 161660 |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式 (LOF) |
| 基金合同生效日 | 2007 年 4 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 3,030,088,555.94 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 | 2007 年 7 月 18 日 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金主要投资于符合中国经济发展方向, 依靠技术自主创新、领先的经营模式或优势的品牌、渠道等因素获得业绩持续 |
|------|--|

| | |
|--------|---|
| | 高速增长,从而推动中国经济结构提升的上市公司,分享中国经济发展过程中结构性的高速增长;通过积极主动的分散化投资策略,在严格控制风险的前提下实现基金资产的持续增长,为基金持有人获取长期稳定的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金认为股价上升的主要推动力来自于企业盈利的不断增长。在中国经济长期高速增长的大背景下,许多企业在一定时期表现出较高的成长性,但只有符合产业结构发展趋势,同时在技术创新、经营模式、品牌、渠道、成本等方面具有领先优势的企业,才能保持业绩持续高速增长,而这些企业正是本基金重点投资的目标和获得长期超额回报的基础。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×80%+中债综合全价(总值)指数收益率×20%。 |
| 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 |

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 | 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、深圳证券交易所 |

§ 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(2019年1月1日-2019年6月30日) |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益 | 95,027,577.35 |
| 本期利润 | 869,835,530.94 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.2760 |
| 本期基金份额净值增长率 | 34.47% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.4668 |
| 期末基金资产净值 | 3,238,065,909.53 |
| 期末基金份额净值 | 1.069 |

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）。

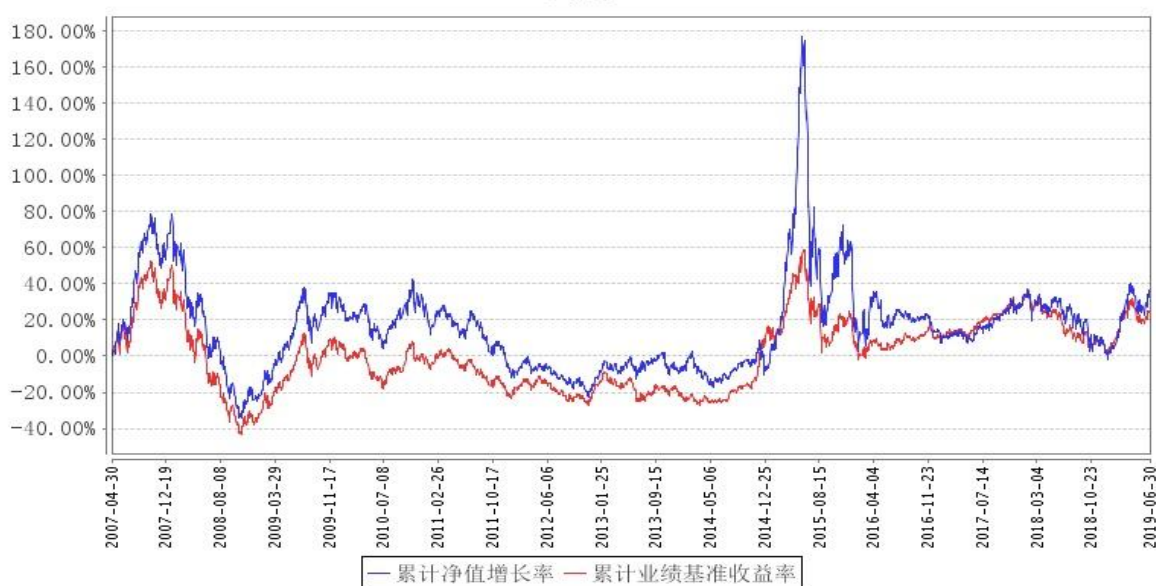
3.2 基金净值表现

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 | 7.44% | 1.38% | 4.37% | 0.93% | 3.07% | 0.45% |
| 过去三个月 | 2.10% | 1.74% | -0.90% | 1.22% | 3.00% | 0.52% |
| 过去六个月 | 34.47% | 1.64% | 21.47% | 1.24% | 13.00% | 0.40% |
| 过去一年 | 10.09% | 1.67% | 8.21% | 1.22% | 1.88% | 0.45% |
| 过去三年 | 13.12% | 1.27% | 17.58% | 0.89% | -4.46% | 0.38% |
| 自基金合同生效起至今 | 38.80% | 1.78% | 24.75% | 1.42% | 14.05% | 0.36% |

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

融通领先成长混合（LOF）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、本基金是由原通宝证券投资基金转型而来，转型日期为2007年4月30日；

2、本基金业绩基准项目分段计算，其中2015年9月30日之前（含此日）采用“沪深300

指数收益率×80%+中信标普全债指数收益率×20%。”，2015年10月1日起使用新基准即“沪深300指数收益率×80%+中债综合全价(总值)指数收益率×20%”。

§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2019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、融通新区域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、融通核心价值混合型证券投资基金(QDII) (原融通丰利四分法证券投资基金(QDII)转型而来)、融通超短债债券型证券投资基金、融通通盈灵活配置混合型证券投资基金 (原融通通盈保本混合型证券投资基金转型而来)、融通通慧混合型证券投资基金 (原融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金转型而来)。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 | | |
| 邹曦 | 本基金的 基金经理、 权益投资 总监 | 2017/2/18 | - | 18 | 邹曦先生, 中国人民银行研究生部金融学硕士, 18 年证券投资从业经历, 具有基金从业资格。2001 年 2 月加入融通基金管理有限公司, 历任市场拓展部总监助理、机构理财部总监助理、行业分析师、宏观策略分析师、基金管理部总监、研究部总监、公司权益投资负责人、融通行行业景气证券投资基金基金经理、融通内需驱动混合型证券投资基金基金经理、融通新能源汽车主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 现任公司权益投资总监、融通行行业景气证券投资基金基金经理、融通领先成长混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理。 |
| 何龙 | 本基金的 基金经理 | 2018/8/23 | - | 7 | 何龙先生, 武汉大学金融学硕士, 7 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, 历任金融行业研究员、策略研究员、融通新蓝筹证券投资基金基金经理, 现任融通领先成长混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理、融通研究优选混合型证券投资基金基金经理。 |

注: 任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写; 证券从业年限以从事证券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

2019年年初,A股市场出现了一轮大级别反弹,有2018年超跌后反弹的因素,也有上市公司商誉减值风险落地的因素,但更多还是宏观和政策层面有利的边际变化,包括社融的大超预期,以及科创板加速度推进都刺激了市场情绪进入阶段高点,并持续酝酿。更重要的是中美贸易谈判进入实质性阶段,2018年的不确定性阶段烟消云散。在这个背景下,我们在一季度转向乐观,在维持了工程机械,农业养殖,5G等高景气方向的同时,并根据地产投资链的新增变化,增加了地产链后周期板块的相关配置。在顶层设计对资产市场进行重新定位后,适度超配非银金融的高贝塔板块显得更有必要。

而二季度市场呈现冲高回落态势,主要因为市场持续宽松预期在二季度得到了官方修正,一季度社融引发的“大放水”预期也戛然而止。虽然短期市场承压,但我们认为中长期并非坏事,中国经济也将真正进入以量换质世代,市场中长期的估值中枢有望持续抬升。而贸易战的反复也放大了二季度市场的波动,但相对去年,市场韧性有明显提升,也预示中美摩擦的常态化已经形成市场的共识,即便G20峰会有明显缓和,但是我们也没有因为谈判本身调整大势研判。我们延续之前市场结构性行情的判断,组合继续保持高仓位运行,淡化总量经济和贸易谈判本身的重要性。我们总体思路是:(1)对宏观经济的研判我们认为结构重于总量。(2)对中美贸易战,产

业结构顺势转型重于谈判本身。总体而言，在二季度我们在操作上面过虑随机事件对组合的冲击，风格和大类资产进行中性跟随，着重通过行业比较，在消费品和投资品中筛选长期受益于存量经济重估，估值中枢有望持续提升的结构性品种。选股也继续采取多元化阿尔法的思路，控制对单一股和单一方向的风险敞口，获取中长期稳健的行业阿尔法和个股阿尔法，为持有人获取真正意义上的风险调整后收益，力求不断提升客户的长期实际持有收益。

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 1.069 元；本报告期基金份额净值增长率为 34.47%，业绩比较基准收益率为 21.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观因素（包括货币政策、房地产调控政策等）等依然会处于偏紧状态下，大概率可以看到财税体制的创新优化推动基建投资的恢复性增长，对土地财政的依赖将有所下降。总体平衡下地产建安+基建投资保持小幅增长。如果相关周期行业需求仍能表现为平稳增长，行业龙头公司继续保持较高盈利增速，则盈利增长的能见度开始显现，部分周期投资品龙头公司的估值水平将发生跃迁。因此我们判断，A 股市场将继续呈现结构性行情，而核心资产效应将从消费品向行业竞争结构不断优化的投资品扩散。

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、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

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，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：融通领先成长混合型证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 本期末 2019 年 6 月 30 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|-------------|------------------------|--------------------------|
| 资 产： | | |
| 银行存款 | 160,309,167.97 | 243,804,305.59 |
| 结算备付金 | 3,042,208.32 | 4,066,572.96 |
| 存出保证金 | 513,667.55 | 321,222.87 |
| 交易性金融资产 | 3,060,900,867.33 | 2,385,291,270.17 |
| 其中：股票投资 | 3,060,192,175.10 | 2,385,291,270.17 |
| 基金投资 | - | - |

| | | |
|-----------------|-------------------|--------------------|
| 债券投资 | 708,692.23 | - |
| 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 | 28,644,588.26 | - |
| 应收利息 | 35,074.49 | 57,772.77 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 138,961.91 | 126,349.68 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 3,253,584,535.83 | 2,633,667,494.04 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 | 上年度末 |
| | 2019年6月30日 | 2018年12月31日 |
| 负 债: | | |
| 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 | - | 59,516,628.66 |
| 应付赎回款 | 8,502,380.99 | 609,689.74 |
| 应付管理人报酬 | 3,812,143.65 | 3,382,738.32 |
| 应付托管费 | 635,357.27 | 563,789.71 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 2,071,810.76 | 1,940,809.61 |
| 应交税费 | 65,654.03 | 65,651.96 |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 431,279.60 | 650,191.89 |
| 负债合计 | 15,518,626.30 | 66,729,499.89 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 1,176,885,165.72 | 1,253,865,178.21 |
| 未分配利润 | 2,061,180,743.81 | 1,313,072,815.94 |
| 所有者权益合计 | 3,238,065,909.53 | 2,566,937,994.15 |
| 负债和所有者权益总计 | 3,253,584,535.83 | 2,633,667,494.04 |

注：报告截止日2019年6月30日，基金份额净值1.069元，基金份额总额3,030,088,555.94份。

6.2 利润表

会计主体：融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至 2019年6月30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至 2018年6月30日 |
|---------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 一、收入 | 903,504,212.02 | -80,994,275.41 |
| 1. 利息收入 | 839,902.32 | 893,902.87 |
| 其中：存款利息收入 | 839,282.90 | 684,439.43 |
| 债券利息收入 | 619.42 | 209,463.44 |
| 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 | 127,685,303.62 | 142,835,024.90 |
| 其中：股票投资收益 | 105,642,202.02 | 114,870,414.18 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 171,168.85 | 291,674.40 |
| 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 | 21,871,932.75 | 27,672,936.32 |
| 3. 公允价值变动收益 | 774,807,953.59 | -224,809,947.81 |
| 4. 汇兑收益 | - | - |
| 5. 其他收入 | 171,052.49 | 86,744.63 |
| 减：二、费用 | 33,668,681.08 | 36,543,606.23 |
| 1. 管理人报酬 | 22,428,450.60 | 25,081,361.40 |
| 2. 托管费 | 3,738,075.08 | 4,180,226.97 |
| 3. 销售服务费 | - | - |
| 4. 交易费用 | 7,312,384.16 | 6,951,985.71 |
| 5. 利息支出 | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6. 税金及附加 | 2.20 | 1.32 |
| 7. 其他费用 | 189,769.04 | 330,030.83 |
| 三、利润总额 | 869,835,530.94 | -117,537,881.64 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润 | 869,835,530.94 | -117,537,881.64 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019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) | 1,253,865,178.21 | 1,313,072,815.94 | 2,566,937,994.15 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润) | - | 869,835,530.94 | 869,835,530.94 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 | -76,980,012.49 | -121,727,603.07 | -198,707,615.56 |
| 其中：1. 基金申购款 | 41,627,977.32 | 63,839,105.39 | 105,467,082.71 |
| 2. 基金赎回款 | -118,607,989.81 | -185,566,708.46 | -304,174,698.27 |
| 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) | 1,176,885,165.72 | 2,061,180,743.81 | 3,238,065,909.53 |
| 项目 | 上年度可比期间 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) | 1,363,030,610.74 | 2,177,574,276.26 | 3,540,604,887.00 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润) | - | -117,537,881.64 | -117,537,881.64 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 | -103,675,796.29 | -171,394,534.28 | -275,070,330.57 |
| 其中：1. 基金申购款 | 22,318,711.84 | 35,573,671.71 | 57,892,383.55 |
| 2. 基金赎回款 | -125,994,508.13 | -206,968,205.99 | -332,962,714.12 |
| 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) | 1,259,354,814.45 | 1,888,641,860.34 | 3,147,996,674.79 |

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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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、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。

6.4.4 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

6.4.4.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018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 | 35,173,989.00 | 0.73% | - | - |

6.4.4.1.2 权证交易

无。

6.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2019年1月1日至2019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 | 32,758.52 | 0.75 | - | - |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 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 | - | - | - | - |

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 2019年1月1日至 2019年6月30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至 2018年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 22,428,450.60 | 25,081,361.40 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 6,192,052.22 | 7,072,267.54 |

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 1.50% 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。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至 2019年6月30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至 2018年6月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,738,075.08 | 4,180,226.97 |

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 0.25% 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：

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

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.4.4 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固有资金投资本基金的情况

无。

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

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2019 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 | |
|-------|------------------------|----------------------|--------------------------|----------------------|
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的比例 | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的比例 |
| 新时代证券 | 1,567,398.12 | 0.05% | 1,567,398.12 | 0.05% |

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

| 关联方名称 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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 |
| 中国建设银行 | 160,309,167.97 | 800,362.95 | 111,602,608.27 | 653,156.74 |

注：本基金的银行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。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.5 期末(2019 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

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|-----------|----------|------------|----------|------------|------------------|------------|------------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功 认购日 | 可流通日 | 流通受 限类型 | 认购 价格 | 期末估值 单价 | 数量 (单位： 股) | 期末 成本总额 | 期末估值总 额 | 备注 |
| 300788 | 中信出版 | 2019\6\27 | 2019\7\5 | 新股流 通受限 | 14.85 | 14.85 | 1,556 | 23,106.60 | 23,106.60 | - |
| 601236 | 红塔证券 | 2019\6\26 | 2019\7\5 | 新股流 通受限 | 3.46 | 3.46 | 9,789 | 33,869.94 | 33,869.94 | - |

| 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------|----------|------------|----------|------------|------------------|------------|------------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功 认购日 | 可流通日 | 流通受 限类型 | 认购 价格 | 期末估值 单价 | 数量 (单位： 张) | 期末 成本总额 | 期末估值总 额 | 备注 |
| 123027 | 蓝晓转债 | 2019\06\11 | 2019\7\4 | 新债流 通受限 | 100.00 | 100.00 | 7,087 | 708,692.23 | 708,692.23 | - |

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

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 | 3,060,192,175.10 | 94.06 |
| | 其中：股票 | 3,060,192,175.10 | 94.06 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 708,692.23 | 0.02 |
| | 其中：债券 | 708,692.23 | 0.02 |
| | 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 | 163,351,376.29 | 5.02 |
| 8 | 其他各项资产 | 29,332,292.21 | 0.90 |
| 9 | 合计 | 3,253,584,535.83 | 100.00 |

7.2 报告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 | 47,394,225.56 | 1.46 |
| B | 采矿业 | 363,431.25 | 0.01 |
| C | 制造业 | 1,997,713,091.25 | 61.69 |
| 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 | 116,119,565.84 | 3.59 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 48,691,725.20 | 1.50 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 189,602,065.88 | 5.86 |
| J | 金融业 | 226,366,499.63 | 6.99 |
| K | 房地产业 | 130,447,882.98 | 4.03 |
| L | 租赁和商务服务业 | 248,712,628.05 | 7.68 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 21,346,959.40 | 0.66 |
| 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 | 33,410,993.46 | 1.03 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 23,106.60 | 0.00 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 3,060,192,175.10 | 94.51 |

7.3 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(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|------------|----------------|--------------|
| 1 | 601888 | 中国国旅 | 2,805,557 | 248,712,628.05 | 7.68 |
| 2 | 600031 | 三一重工 | 15,734,656 | 205,809,300.48 | 6.36 |
| 3 | 000338 | 潍柴动力 | 13,650,881 | 167,769,327.49 | 5.18 |
| 4 | 300630 | 普利制药 | 2,877,339 | 165,792,273.18 | 5.12 |
| 5 | 000661 | 长春高新 | 414,191 | 139,996,558.00 | 4.32 |
| 6 | 600801 | 华新水泥 | 5,669,245 | 114,802,211.25 | 3.55 |
| 7 | 601100 | 恒立液压 | 2,645,204 | 83,006,501.52 | 2.56 |
| 8 | 601933 | 永辉超市 | 7,352,889 | 75,072,996.69 | 2.32 |
| 9 | 600887 | 伊利股份 | 2,120,800 | 70,855,928.00 | 2.19 |
| 10 | 600585 | 海螺水泥 | 1,703,949 | 70,713,883.50 | 2.18 |

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>）的半年度报告正文。

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 | 600031 | 三一重工 | 104,694,626.93 | 4.08 |
| 2 | 000338 | 潍柴动力 | 72,239,800.59 | 2.81 |
| 3 | 600887 | 伊利股份 | 64,383,789.55 | 2.51 |
| 4 | 601933 | 永辉超市 | 60,757,842.64 | 2.37 |
| 5 | 002142 | 宁波银行 | 53,609,054.28 | 2.09 |
| 6 | 000651 | 格力电器 | 52,169,257.83 | 2.03 |
| 7 | 002475 | 立讯精密 | 45,887,431.58 | 1.79 |
| 8 | 000568 | 泸州老窖 | 42,306,012.40 | 1.65 |
| 9 | 600547 | 山东黄金 | 41,661,385.00 | 1.62 |
| 10 | 603160 | 汇顶科技 | 39,795,332.78 | 1.55 |
| 11 | 601888 | 中国国旅 | 39,672,236.73 | 1.55 |
| 12 | 002439 | 启明星辰 | 39,008,856.43 | 1.52 |
| 13 | 000661 | 长春高新 | 38,862,758.86 | 1.51 |
| 14 | 601628 | 中国人寿 | 38,516,657.78 | 1.50 |
| 15 | 300232 | 洲明科技 | 37,188,087.60 | 1.45 |
| 16 | 000002 | 万科A | 33,479,477.39 | 1.30 |
| 17 | 300498 | 温氏股份 | 32,766,160.30 | 1.28 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 18 | 002157 | 正邦科技 | 32,659,928.15 | 1.27 |
| 19 | 603019 | 中科曙光 | 31,678,207.36 | 1.23 |
| 20 | 000031 | 大悦城 | 31,602,580.88 | 1.23 |

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 | 601888 | 中国国旅 | 119,865,993.05 | 4.67 |
| 2 | 600031 | 三一重工 | 99,038,385.38 | 3.86 |
| 3 | 300164 | 通源石油 | 77,869,285.75 | 3.03 |
| 4 | 600801 | 华新水泥 | 64,413,930.75 | 2.51 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 64,264,308.32 | 2.50 |
| 6 | 600276 | 恒瑞医药 | 64,044,030.21 | 2.49 |
| 7 | 000333 | 美的集团 | 59,796,887.24 | 2.33 |
| 8 | 600585 | 海螺水泥 | 56,488,624.64 | 2.20 |
| 9 | 000338 | 潍柴动力 | 50,866,549.04 | 1.98 |
| 10 | 601288 | 农业银行 | 49,568,105.00 | 1.93 |
| 11 | 600048 | 保利地产 | 45,080,174.57 | 1.76 |
| 12 | 600271 | 航天信息 | 43,868,430.06 | 1.71 |
| 13 | 600027 | 华电国际 | 41,576,767.31 | 1.62 |
| 14 | 002557 | 洽洽食品 | 41,071,454.74 | 1.60 |
| 15 | 600547 | 山东黄金 | 41,052,730.69 | 1.60 |
| 16 | 000661 | 长春高新 | 40,867,523.95 | 1.59 |
| 17 | 002304 | 洋河股份 | 40,574,948.30 | 1.58 |
| 18 | 002110 | 三钢闽光 | 40,145,663.44 | 1.56 |
| 19 | 601336 | 新华保险 | 39,485,169.15 | 1.54 |
| 20 | 002410 | 广联达 | 37,618,239.22 | 1.47 |

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 | 2,301,079,439.32 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 2,506,628,690.00 |

注：表中“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均指成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |

| | | | |
|----|-----------|------------|------|
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 708,692.23 | 0.02 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 708,692.23 | 0.02 |

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 | 123027 | 蓝晓转债 | 7,087 | 708,692.23 | 0.02 |

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 | 513,667.55 |
| 2 | 应收证券清算款 | 28,644,588.26 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 35,074.49 |
| 5 | 应收申购款 | 138,961.91 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 29,332,292.21 |

7.12.4 报告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 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资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 |
| 161,677 | 18,741.62 | 29,614,987.79 | 0.98% | 3,000,473,568.15 | 99.02% |

8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额(份) | 占上市总份额比例 |
|----|------------|--------------|----------|
| 1 | 天津证券登记有限公司 | 5,242,927.00 | 4.06% |
| 2 | 叶风 | 1,921,325.00 | 1.49% |
| 3 | 王金明 | 1,610,400.00 | 1.25% |
| 4 | 卢砺锋 | 1,178,034.00 | 0.91% |
| 5 | 李玲 | 1,120,646.00 | 0.87% |
| 6 | 许玉明 | 1,068,572.00 | 0.83% |
| 7 | 黄世平 | 1,062,027.00 | 0.82% |
| 8 | 吴颂今 | 1,008,070.00 | 0.78% |
| 9 | 刘宝年 | 650,345.00 | 0.50% |

| | | | |
|----|-----|--------------|--------|
| 10 | 李睿智 | 624, 287. 00 | 0. 48% |
|----|-----|--------------|--------|

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 | 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 | 83, 639. 47 | 0. 0028% |

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情况

| | |
|--------------------------------|---|
| 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 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|----------------------|
| 基金合同生效日（2007年4月30日）基金份额总额 | 500, 000, 000. 00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 3, 228, 273, 567. 51 |
| 本报告期基金总申购份额 | 107, 154, 288. 34 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 305, 339, 299. 91 |
| 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 | 3, 030, 088, 555. 94 |

§ 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

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

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 2011 年 10 月 20 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 | 2 | 1,273,038,663.43 | 26.49% | 1,160,154.44 | 26.49% | - |
| 中信证券 | 1 | 1,064,691,024.31 | 22.16% | 970,252.41 | 22.15% | - |
| 国盛证券 | 1 | 692,148,261.78 | 14.41% | 630,753.36 | 14.40% | - |
| 东北证券 | 1 | 684,753,817.17 | 14.25% | 624,010.98 | 14.25% | - |
| 银河证券 | 1 | 483,341,157.55 | 10.06% | 440,472.50 | 10.06% | - |
| 国泰君安 | 1 | 380,296,046.07 | 7.91% | 346,569.29 | 7.91% | - |
| 西南证券 | 2 | 117,931,989.99 | 2.45% | 107,473.48 | 2.45% | - |
| 兴业证券 | 1 | 73,183,229.47 | 1.52% | 66,696.96 | 1.52% | - |
| 新时代证券 | 1 | 35,173,989.00 | 0.73% | 32,758.52 | 0.75% | - |
| 申万宏源 | 2 | 178,761.69 | 0.00% | 166.49 | 0.00% | - |
| 国信证券 | 1 | 101,064.80 | 0.00% | 92.12 | 0.00% | - |
| 招商证券 | 1 | 48,093.88 | 0.00% | 43.85 | 0.00% | - |
| 华安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 高华证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 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

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

本基金本报告期终止一个上海证券交易单元。

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 |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 1,205,952.95 | 27.97% | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 2,424,000.00 | 56.23% | - | - | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 681,006.12 | 15.80% | - | - | - | - |
| 新时代证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 高华证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |

融通基金管理有限公司

2019年8月24日