

融通中证人工智能主题指数证券投资基金（LOF）

2018年半年度报告摘要

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：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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据中证人工智能主题指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）基金合同约定，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基金合同。

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

基金名称	融通人工智能主题（LOF）
基金代码	005021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年6月13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	315,079,262.14份
基金合同期限	不定期
基金份额上市证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2017年6月13日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证人工智能主题指数，在追求跟踪偏离度最小化的前提下，力争实现基金净值增长率与业绩比较基准（中证人工智能主题指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率×5%）之间的收益差额最大化。
投资策略	本基金主要采用被动式指数投资策略，即按照标的指数成份股的构成及其权重构建跟踪组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金在追求跟踪偏离度最小化的前提下，力争实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的收益差额最大化。
风险收益特征	本基金为中证人工智能主题指数跟踪基金，属于股票型基金中的中高风险基金，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。
风险提示	本基金为股票型基金，存在较高风险，投资者在投资前应认真阅读基金合同、招募说明书及基金产品资料概要等文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等对基金的风险收益特征做出恰当的判断。

2.3 基金管理人及基金托管人

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
法定代表人	张帆	田国立
负责人	张帆	田国立
注册地址	深圳市福田区福安社区福安路39号融通基金大厦1001室	北京市西城区金融大街25号
办公地址	深圳市福田区福安社区福安路39号融通基金大厦1001室	北京市西城区金融大街25号
客服电话	400-888-8888、0755-1399-0888	95533
网址	http://www.rtfund.com	http://www.ccb.com

2.4 信息披露方式

本基金年度报告正文刊登在管理人网站：<http://www.rtfund.com>
基金年度报告摘要刊登在：<http://www.rtfund.com>

§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

项目	金额单位：人民币元
1.1 期间损益总额	报告期(2018年1月1日至2018年6月30日)
本期已实现损益	1,275,064.27
本期公允价值变动损益	-30,994,204.58
期间净损益(公允价值变动损益+已实现损益)	-29,719,140.31
1.2 期末基金资产净值	报告期(2018年6月30日)
期末基金资产净值	315,079,262.14
期末基金份额净值	1.0160

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（不含公允价值变动损益）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 基金净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较

期间	融通基金净值增长率	业绩比较基准收益率	差
过去一个月	-4.08%	-3.70%	-0.38%
过去三个月	-36.11%	-37.01%	0.90%
过去六个月	-50.61%	-52.01%	1.40%
过去一年	-59.44%	-61.01%	1.57%
过去三年	-72.6%	-73.1%	0.5%

3.2.2 自基金成立以来的基金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

注：本基金的建仓期为自合同生效日起6个月，至建仓期结束，各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及基金经理的经验

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，公司注册资产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）、融通易支付货币市场基金、融通先行先锋混合基金、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、融通先锋四只基金（ODII-FOF）基金、融通T财货币市场基金、融通可转债债券基金、融通通泰保本混合基金、融通通瑞债券基金（LOF）、融通通源恒利债券基金、融通月月薪定期开放债券基金、融通健康产业混合基金、融通转型二动力混合基金、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、融通通利分级指数基金、融通消费升级混合基金、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、融通安联债券基金、融通通优债券基金、融通乾研精选混合基金、融通新趋势混合基金、融通国企改革主题混合基金、融通通和债券基金、融通T沪深深智慧生活混合基金、融通现金宝货币市场基金、融通通祺债券基金、融通稳利债券基金、融通通源债券基金、融通通型债券基金、融通通裕债券基金、融通通顺债券基金、融通通定期开放债券基金、融通人工智能主题基金（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（ODII）、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）及基金助理简介

姓名	职务	任本基金基金经理时间	证券从业年限
何庆	本基金基金经理、融通基金助理	2017年7月13日	10

注：基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，此后的非首任基金经理，任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金基金合同的约定，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人的利益的行为，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之间同交易的交易价差进行了分析，各投资组合的间同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

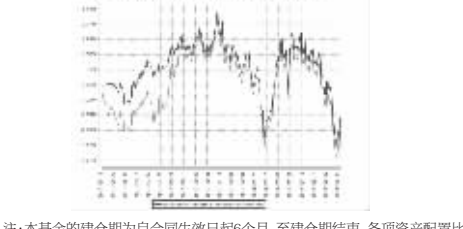
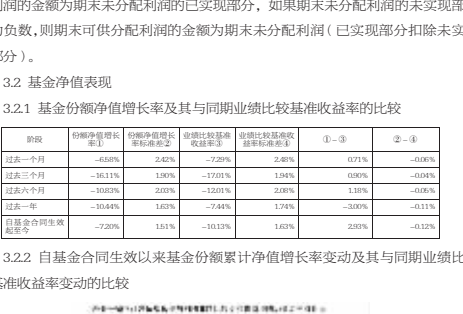
6.3 所有者权益（基金净值）变动表

项目	金额单位：人民币元
1.1 期间损益总额	报告期(2018年1月1日至2018年6月30日)
本期已实现损益	1,275,064.27
本期公允价值变动损益	-30,994,204.58
期间净损益(公允价值变动损益+已实现损益)	-29,719,140.31
1.2 期末基金资产净值	报告期(2018年6月30日)
期末基金资产净值	315,079,262.14
期末基金份额净值	1.0160

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（不含公允价值变动损益）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）。



注：本基金的建仓期为自合同生效日起6个月，至建仓期结束，各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及基金经理的经验

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，公司注册资产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）、融通易支付货币市场基金、融通先行先锋混合基金、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、融通先锋四只基金（ODII-FOF）基金、融通T财货币市场基金、融通可转债债券基金、融通通泰保本混合基金、融通通瑞债券基金（LOF）、融通通源恒利债券基金、融通月月薪定期开放债券基金、融通健康产业混合基金、融通转型二动力混合基金、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、融通通利分级指数基金、融通消费升级混合基金、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、融通安联债券基金、融通通优债券基金、融通乾研精选混合基金、融通新趋势混合基金、融通国企改革主题混合基金、融通通和债券基金、融通T沪深深智慧生活混合基金、融通现金宝货币市场基金、融通通祺债券基金、融通稳利债券基金、融通通源债券基金、融通通型债券基金、融通通裕债券基金、融通通顺债券基金、融通通定期开放债券基金、融通人工智能主题基金（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（ODII）、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）及基金助理简介

姓名	职务	任本基金基金经理时间	证券从业年限
何庆	本基金基金经理、融通基金助理	2017年7月13日	10

注：基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，此后的非首任基金经理，任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金基金合同的约定，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人的利益的行为，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之间同交易的交易价差进行了分析，各投资组合的间同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

项目	金额单位：人民币元
1.1 期间损益总额	报告期(2018年1月1日至2018年6月30日)
本期已实现损益	1,275,064.27
本期公允价值变动损益	-30,994,204.58
期间净损益(公允价值变动损益+已实现损益)	-29,719,140.31
1.2 期末基金资产净值	报告期(2018年6月30日)
期末基金资产净值	315,079,262.14
期末基金份额净值	1.0160

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（不含公允价值变动损益）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）。

本基金报告期内未发生异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

本基金在本报告期内，基金日均跟踪偏离为0.04%，年化跟踪误差为0.82%，符合基金合同约定。

4.4.2 报告期内基金的投资表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.9280元；本报告基金份额净值增长率为-10.83%，业绩比较基准收益率为-12.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前我国经济正向高质量发展迈进，市场主体韧性增强，国内巨大规模市场的回旋空间广阔，完全具备打赢重大风险攻坚战和应对外部风险的诸多有利条件。在去杠杆背景下，政策会根据市场情况进行微调，6月20日国常会指出保持流动性合理充裕，6月24日央行年内第三次宣布降准。我们认为宏观经济政策方向不变，但可能会适时进行阶段性微调。

近期市场下跌主要原因是去杠杆背景下的微观资金冲击和中美贸易摩擦影响，但市场基本面并未恶化，A股盈利增长韧性较强，双重因素使得市场估值快速下降，并低于16年1月底的估值水平，目前全部A股PE、PB分别是15倍、1.6倍，已经低于16年1月底的17.7倍、1.9倍。我们认为，从估值看当前市场具备战略投资价值，但受制于去杠杆和贸易战的不确定性，市场波动可能会加大，敏感性较低的行业更容易获得超额收益。

关于人工智能指数，该指数上半年下跌12.74%，跌幅较大，其中二季度下跌17.87%，主要原因是自中美贸易战以来，美国针对中国商品特别是科技产品，包括2025计划实施各类限制，造成了科技股的持续下跌，而人工智能是科技股中弹性较大的板块。但从战略上看，贸易战坚定了中国发展高科技技术产业的决心，并加大投入。从基本面的看，过去几个季度人工智能分成股的收入规模在加速增长，利润也保持正增长。我们看好人工智能指数的长期表现，也看好其短期投资机会。

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，减少或避免估值错误的发生。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应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和程序时，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程序、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。本基金基金经理参与估值决定，参与估值流程各环节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，符合相关法律法规及基金合同的约定。

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二十人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

项目	金额单位：人民币元
1.1 期间损益总额	报告期(2018年1月1日至2018年6月30日)
本期已实现损益	1,275,064.27
本期公允价值变动损益	-30,994,204.58
期间净损益(公允价值变动损益+已实现损益)	-29,719,140.31
1.2 期末基金资产净值	报告期(2018年6月30日)
期末基金资产净值	315,079,262.14
期末基金份额净值	1.0160

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（不含公允价值变动损益）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）。

§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基金估值业务有损害基金份额持有人利益的行为。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：融通中证人工智能主题指数证券投资基金（LOF）
报告截止日：2018年6月30日

资产	本报告期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
货币资金	17,771,123.63	12,397,442.23
结算备付金	171,042.04	684,004.04
存出保证金	60,102.01	52,338.11
应收利息	276,162,294.89	128,362,892.27
应收股利	276,162,294.89	128,362,892.27
买入返售金融资产	-	-
其他应收款	-	-
资产总计	315,079,262.14	269,819,568.68
负债和所有者权益	315,079,262.14	269,819,568.68
负债：	-	-
应付利息	-	-
应付股利	-	-
其他应付款	-	-
所有者权益（基金净值）	315,079,262.14	269,819,568.68
所有者权益合计	315,079,262.14	269,819,568.68

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值0.9280元，基金份额总额315,079,262.14份。

6.2 利润表

会计主体：融通中证人工智能主题指数证券投资基金（LOF）
报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

项目	本报告 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
利息收入	986,720.72	21,397,880.71
投资收益	-	-
公允价值变动收益	-30,994,204.58	-
其他收入	-	-
资产减值损失	-	-
营业利润	-29,719,140.31	21,397,880.71
营业外收入	-	-
营业外支出	-	-
利润总额	-29,719,140.31	21,397,880.71
所得税费用	-	-
净利润	-29,719,140.31	21,397,880.71
其他综合收益	-	-
综合收益总额	-29,719,140.31	21,397,880.71

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值0.9280元，基金份额总额315,079,262.14份。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

项目	本报告 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、所有者权益	-29,719,140.31	21,397,880.71
1. 未分配利润	-29,719,140.31	21,397,880.71
2. 其他综合收益	-	-
所有者权益合计	-29,719,140.31	21,397,880.71
二、所有者权益变动	-	-
1. 未分配利润	-29,719,140.31	21,397,880.71
2. 其他综合收益	-	-
所有者权益合计	-29,719,140.31	21,397,880.71

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值0.9280元，基金份额总额315,079,262.14份。

6.4 现金流量表

项目	本报告 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、经营活动产生的现金流量	986,720.72	21,397,880.71
二、投资活动产生的现金流量	-30,994,204.58	-
三、筹资活动产生的现金流量	-	-
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响	-	-
五、现金及现金等价物净增加额	-29,719,140.31	21,397,880.71
六、期初现金及现金等价物余额	17,771,123.63	12,397,442.23
七、期末现金及现金等价物余额	17,771,123.63	12,397,442.23

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值0.9280元，基金份额总额315,079,262.14份。

6.5 所有者权益（基金净值）变动表

项目	本报告 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、所有者权益	-29,719,140.31	21,397,880.71
1. 未分配利润	-29,719,140.31	21,397,880.71
2. 其他综合收益	-	-
所有者权益合计	-29,719,140.31	21,397,880.71
二、所有者权益变动	-	-
1. 未分配利润	-29,719,140.31	21,397,880.71
2. 其他综合收益	-	-
所有者权益合计	-29,719,140.31	21,397,880.71

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值0.9280元，基金份额总额315,079,262.14份。

6.6 现金流量表

项目	本报告 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、经营活动产生的现金流量	986,720.72	21,397,880.71
二、投资活动产生的现金流量	-30,994,204.58	-
三、筹资活动产生的现金流量	-	-
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响	-	-
五、现金及现金等价物净增加额	-29,719,140.31	21,397,880.71
六、期初现金及现金等价物余额	17,771,123.63	12,397,442.23
七、期末现金及现金等价物余额	17,771,123.63	12,397,442.23

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值0.9280元，基金份额总额315,079,262.14份。

6.7 所有者权益（基金净值）变动表

项目	本报告 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、所有者权益	-29,719,140.31	21,397,880.71
1. 未分配利润	-29,719,140.31	21,397,880.71
2. 其他综合收益	-	-
所有者权益合计	-29,719,140.31	21,397,880.71
二、所有者权益变动	-	-
1. 未分配利润	-29,719,140.31	21,397,880.71
2. 其他综合收益	-	-
所有者权益合计	-29,719,140.31	21,397,880.71

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值0.9280元，基金份额总额315,079,262.14份。

6.8 现金流量表

项目	本报告 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、经营活动产生的现金流量	986,720.72	21,397,880.71
二、投资活动产生的现金流量	-30,994,204.58	-
三、筹资活动产生的现金流量	-	-
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响	-	-
五、现金及现金等价物净增加额	-29,719,140.31	21,397,880.71
六、期初现金及现金等价物余额	17,771,123.63	12,397,442.23
七、期末现金及现金等价物余额	17,771,123.63	12,397,44