融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金 2018年年度报告摘要

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: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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金(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。

本报告中的财务资料已经审计,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	融通证券分级		
场内简称	融通证券		
基金主代码	161629		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年7月17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	52,022,923.15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	2015年8月3日		
下属分级基金的基金简称	融通证券分级	证券A基	证券B基
下属分级基金的场内简称	融通证券分级	证券A基	证券B基
下属分级基金的交易代码	161629	150343	150344
报告期末下属分级基金份额总额	43,076,791.15份	4,473,066.00份	4,473,066.00份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪中证全指证券公司指数。在正常市场情况下,力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。		
投资策略	本基金采用完全复制法进行投资,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动对投资组合进行相应调整。		
业绩比较基准	95%×中证全指证券公司价格指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率(税后)。		
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高预期风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看,融通证券A份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征;融通证券B份额具有高预期风险、预期收益相对较高的特征。		
下属分级基金的风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高预期风险、较高预期收益的特征。	融通证券A份额为稳健收益类份额,具有低预期风险、预期收益相对稳定的风险收益特征。	融通证券B份额为积极收益类份额,具有高预期风险、预期收益相对较高的风险收益特征。

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	徐卫东	田青
	联系电话	(0755)26948666	(010)67595096
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	tianqing12h@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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金年度报告备置地点	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、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
本期已实现收益	-11,582,684.28	-6,757,026.61	-131,047,439.94
本期利润	-17,805,827.58	-9,906,697.49	-138,016,969.91
加权平均基金份额本期利润	-0.2832	-0.1227	-0.3810
本期基金份额净值增长率	-23.88%	-12.28%	-17.65%
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	-1.1594	-0.5396	-0.4751
期末基金资产净值	58,213,015.52	59,202,048.40	113,981,110.69
期末基金份额净值	1.119	0.927	1.087

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;

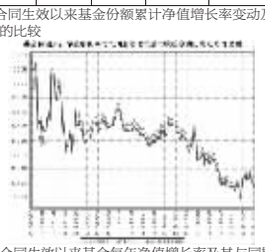
(3) 期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配利润:如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分, 如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

3.2 基金净值表现

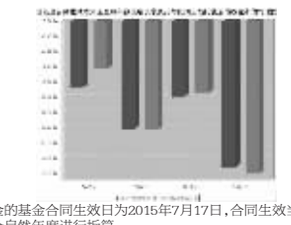
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-0.90%	2.45%	-1.42%	2.44%	0.52%	0.01%
过去六个月	-4.13%	1.95%	-5.35%	1.94%	1.22%	0.01%
过去一年	-23.88%	1.81%	-24.91%	1.81%	1.03%	0.00%
过去三年	-45.01%	1.70%	-45.41%	1.71%	0.40%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-50.90%	1.87%	-49.62%	2.07%	-1.28%	-0.20%

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



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



注:本基金的基金合同生效日为2015年7月17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

根据本基金基金合同规定,本基金(包括融通证券份额、融通证券A基份额、融通证券B基份额)不进行收益分配。

§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 AssetManagement 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		
何天翔	本基金的基金经理、量化投资部副总监	2015年7月17日	-	10	何天翔先生,厦门大学经济学硕士、安徽大学理学学士,10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量化投资部副总监。曾就职于华泰联合证券有限公司任金融工程分析师。2010年3月加入融通基金管理有限公司,历任金融工程研究员、专户投资经理,现任融通深证100指数、融通军工分级、融通证券分级、融通新趋势灵活配置混合、融通通瑞债券、融通人工智能主题指数(LOF)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。

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在严格遵守基金合同的前提下实现持有人利益的最大化是本基金管理的核心思想,并将此原则贯彻于基金的运作始终。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全指证券公司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全指证券公司指数的一个有效工具。

本报告期内,本基金日均跟踪偏离为0.06%,年化跟踪误差为1.20%,符合基金合同约定。

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1.119元;本报告期基金份额净值增长率为-23.88%,业绩比较基准收益率为-24.91%。

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,危中有机,市场担忧的贸易战、经济寻底可能会继续,但好的方面也不少, 比如制度和政策红利的持续释放, 伴随A股国际化海外长期资金的持续加入,以及当前主要指数估值都在历史若干大低点附近。纵观全球,中国经济持续高增长低通胀,好于欧美的低增长低通胀,更好于金砖国家的低增长高通胀,中国优势全球难寻,战略上值得长期拥有。从量化数据看,2018年业绩超预期、盈利上调、以及低波动等因子获得了较高的alpha,反映了业绩为王和安全第一的思维,2019年结构性的机会一定不会少。同时,需要严格防范"暴雷"风险,尽力从基本面和量化两个维度去排雷。

关于证券行业,最新三季报净利润增速-34%,行业盈利水平继续下滑,但行业整体估值水平处于历史低位,截止18年底行业整体PE为22.67,PB为1.19。虽然行业盈利或许仍将寻底,但在证券创新、国际化、科创板等政策红利背景下,证券板块的敏感度和领先性也比较高。

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

根据本基金基金合同约定,本基金(包括融通证券份额、融通证券A基份额、融通证券B基份额)不进行收益分配。

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, 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 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21204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:融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金

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
资 产:		
银行存款	3,940,680.29	4,388,659.58
结算备付金	271,532.41	-
存出保证金	11,324.27	5,406.32
交易性金融资产	55,308,325.14	56,173,537.54
其中:股票投资	55,308,325.14	56,173,537.54
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	1,069.42	839.29
应收股利	-	-
应收申购款	60,748.32	16,344.80
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	59,593,679.85	60,584,787.53
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	446,804.51	1,160,139.91
应付赎回款	722,849.18	63,682.41
应付管理人报酬	56,245.04	52,319.20
应付托管费	12,373.90	11,510.24
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	49,768.75	4,860.87
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	92,622.96	90,226.50
负债合计	1,380,664.33	1,382,739.13
所有者权益:		
实收基金	118,527,698.20	91,736,689.19
未分配利润	-60,314,682.68	-32,534,640.79
所有者权益合计	58,213,015.52	59,202,048.40
负债和所有者权益总计	59,593,679.85	60,584,787.53

注:报告截止日2018年12月31日,融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金(以下简称"融通证券分级基金")之基础份额净值1.119元,融通证券分级基金之A份额参考净值1.003元,融通证券分级基金之B份额参考净值1.235元;融通证券分级基金份额总额52,022,923.15份, 其中融通证券分级基金之基础份额43,076,791.15份,融通证券分级基金之A份额4,473,066.00份,融通证券分级基金之B份额4,473,066.00份。

7.2 利润表

会计主体:融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金

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
一、收入	-16,627,684.42	-8,322,108.66
1.利息收入	27,647.59	36,496.36
其中:存款利息收入	27,614.37	36,468.92
债券利息收入	33.22	27.44
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(损失以"-"填列)	-10,641,708.18	-5,295,290.25
其中:股票投资收益	-11,564,569.76	-6,480,191.46
基金投资收益	-	-
债券投资收益	12,489.48	58,816.56
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	910,372.10	1,126,084.65
3.公允价值变动收益	-6,223,143.30	-3,149,670.88
4.汇兑收益	-	-
5.其他收入	209,519.47	86,356.11
减:二、费用	1,178,143.16	1,584,588.83
1、管理人报酬	551,897.84	860,360.36
2、托管费	121,417.58	189,279.25
3、销售服务费	-	-
4、交易费用	101,722.75	131,539.07
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	403,104.99	403,410.15
三、利润总额	-17,805,827.58	-9,906,697.49
减:所得税费用	-	-
四、净利润	-17,805,827.58	-9,906,697.49

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金

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)	91,736,689.19	-32,534,640.79	59,202,048.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-17,805,827.58	-17,805,827.58
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	26,791,009.01	-9,974,214.31	16,816,794.70
其中:1.基金申购款	175,097,624.05	-79,548,452.05	95,549,172.00
2.基金赎回款	-148,306,615.04	69,574,237.74	-78,732,377.30
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)	118,527,698.20	-60,314,682.68	58,213,015.52
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)	154,941,963.52	-40,960,852.83	113,981,110.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-9,906,697.49	-9,906,697.49
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-63,205,274.33	18,332,909.53	-44,872,364.80
其中:1.基金申购款	37,319,670.89	-10,508,406.17	26,811,264.72
2.基金赎回款	-100,524,945.22	28,841,315.70	-71,683,629.52
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)	91,736,689.19	-32,534,640.79	59,202,048.40

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:

_____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

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。

7.4.1.3 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。

7.4.2 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、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
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。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 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	551,897.84	860,360.36
其中:支付销售机构的客户维护费	126,997.16	126,624.43

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1.00%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.00% / 当年天数。

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

7.4.3.2.2 基金托管费

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
当期发生的基金应支付的托管费	121,417.58	189,279.25

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0.22%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×0.22% / 当年天数。

7.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2018年12月31日		本期末 2017年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占该类别基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占该类别基金总份额的比例
新时代证券	878,074.29	2.04%	1,392,490.00	5.63%

注:上表所述的基金份额为融通证券分级基金之基础份额。

7.4.3.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 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
中国建设银行	3,940,680.29	26,950.11	4,388,659.58	36,118.17

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。

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.3.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.4 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.4.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600030	中信证券	2018-12-25	重大事项停牌	16.01	2019-01-10	17.15	543,616	9,447,220.46	8,703,292.16	-
000987	越秀金控	2018-12-25	重大事项停牌	7.97	2019-01-10	8.77	21,575	213,988.98	171,952.75	-

注:本基金截至2018年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

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	55,308,325.14	92.81
	其中:股票	55,308,325.14	92.81
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	4,212,212.70	7.07
8	其他各项资产	73,142.01	0.12
9	合计	59,593,679.85	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	55,308,325.14	95.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	55,308,325.14	95.01

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末无积极投资部分的股票。

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

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	543,616	8,703,292.16	14.95
2	600837	海通证券	591,896	5,208,684.80	8.95
3	601211	国泰君安	306,449	4,694,798.68	8.06
4	601688	华泰证券	266,402	4,315,712.40	7.41
5	600999	招商证券	209,165	2,802,811.00	4.81
6	000776	广发证券	216,518	2,745,448.24	4.72
7	600958	东方证券	261,864	2,087,056.08	3.59
8	000166	申万宏源	494,616	2,013,087.12	3.46
9	601901	方正证券	335,549	1,781,765.19	3.06
10	601377	兴业证券	342,827	1,590,717.28	2.73

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。

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末无积极投资部分的股票。

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	600030	中信证券	5,255,809.00	8.88
2	600837	海通证券	4,573,682.00	7.73
3	601211	国泰君安	3,395,617.12	5.74
4	601688	华泰证券	2,411,822.43	4.07
5	000776	广发证券	2,292,957.00	3.87
6	600958	东方证券	2,264,888.00	3.83
7	600999	招商证券	2,159,163.00	3.65
8	000166	申万宏源	2,022,541.00	3.42
9	601377	兴业证券	1,430,015.00	2.42
10	002736	国信证券	1,293,976.00	2.19
11	000783	长江证券	1,278,407.00	2.16
12	601901	方正证券	1,263,862.00	2.13
13	601788	光大证券	1,183,186.00	2.00
14	601099	太平洋	1,121,057.75	1.89
15	601198	东兴证券	1,031,303.00	1.74
16	601555	东吴证券	989,280.00	1.67
17	600109	国金证券	959,915.86	1.62
18	000728	国元证券	904,515.00	1.53
19	002673	西部证券	881,421.00	1.49
20	601881	中国银河	822,695.00	1.39

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	600030	中信证券	3,869,911.00	6.54
2	600837	海通证券	3,231,714.00	5.46
3	601211	国泰君安	1,992,908.00	3.37
4	000776	广发证券	1,635,686.00	2.76
5	600958	东方证券	1,394,106.00	2.35
6	000166	申万宏源	1,387,008.00	2.34
7	601688	华泰证券	1,166,383.00	1.97
8	600999	招商证券	1,050,171.00