

融通通利系列证券投资基金之
融通深证 100 指数证券投资基金
2023 年年度报告

2023 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：2024 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

融通通利系列证券投资基金由融通债券投资基金、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共同构成。本年度报告为融通通利系列证券投资基金之子基金融通深证 100 指数证券投资基金（以下简称“本基金”）2023 年年度报告。

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《融通通利系列证券投资基金基金合同》规定，于 2024 年 3 月 26 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 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 12 月 31 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	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 净资产变动表	18
7.4 报表附注	20
§ 8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况	50

8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	50
8.3	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	51
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	55
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	57
8.7	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	57
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	57
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	57
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	57
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
8.12	投资组合报告附注	57
§ 9	基金份额持有人信息	58
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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情况	59
§ 10	开放式基金份额变动	59
§ 11	重大事件揭示	59
11.1	基金份额持有人大会决议	59
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	59
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
11.4	基金投资策略的改变	60
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	60
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
11.8	其他重大事件	63
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	65
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	65
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	65
§ 13	备查文件目录	65
13.1	备查文件目录	65
13.2	存放地点	65
13.3	查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	融通深证 100 指数证券投资基金	
基金简称	融通深证 100 指数	
基金主代码	161604	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2003 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	3,384,344,620.04 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	融通深证 100 指数 A/B	融通深证 100 指数 C
下属分级基金的交易代码	161604	004876
下属分级基金的前端交易代码	161604	-
下属分级基金的后端交易代码	161654	-
报告期末下属分级基金的份额总额	3,370,650,987.93 份	13,693,632.11 份

2.2 基金产品说明

投资目标	运用指数化投资方式，通过控制股票投资组合与深证 100 指数的跟踪误差，力求实现对深证 100 指数的有效跟踪，谋求分享中国经济的持续、稳定增长和中国证券市场的发展，实现基金资产的长期增长，为投资者带来稳定回报。
投资策略	以非债券资产 90%以上的资金对深证 100 指数的成份股进行股票指数化投资。股票指数化投资部分不得低于基金资产的 50%，采用复制法跟踪深证 100 指数，对于因流动性等原因导致无法完全复制深证 100 指数的情况，将采用剩余组合替换等方法避免跟踪误差扩大。
业绩比较基准	深证 100 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%
风险收益特征	风险和预期收益率接近市场平均水平

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
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、15 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		张威	陈四清

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
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、15 层

§ 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	2023 年		2022 年		2021 年	
	融通深证 100 指数 A/B	融通深证 100 指数 C	融通深证 100 指数 A/B	融通深证 100 指数 C	融通深证 100 指数 A/B	融通深证 100 指数 C
本期已实现收益	-15,321,100.70	-129,020.99	15,326,335.75	-27,872.45	429,858,302.16	1,012,945.40
本期利润	-759,578,248.49	-3,018,043.07	-1,487,331,879.76	-4,542,152.38	-18,515,900.75	44,629.83
加权平均基金份额本期利润	-0.2263	-0.2378	-0.4578	-0.4420	-0.0058	0.0051
本期加权平均净值利润率	-16.57%	-17.90%	-29.82%	-29.45%	-0.31%	0.27%
本期基金份额净值增长率	-15.91%	-16.19%	-24.73%	-25.06%	-0.91%	-1.24%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	644,275,599.20	2,199,844.68	1,399,975,347.35	4,469,837.01	1,872,749,245.40	4,960,076.41
期末可供分配基金份额利润	0.1911	0.1606	0.4212	0.3903	0.5979	0.5327
期末基金资产净值	4,014,926,587.13	15,893,476.79	4,723,623,555.71	15,922,005.15	5,930,557,286.71	17,317,030.74
期末基金份额净值	1.191	1.161	1.421	1.390	1.893	1.860
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值增长率	334.01%	2.67%	416.06%	22.50%	585.60%	63.46%

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

相关费用和信用减值损失后的余额，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

融通深证 100 指数 A/B

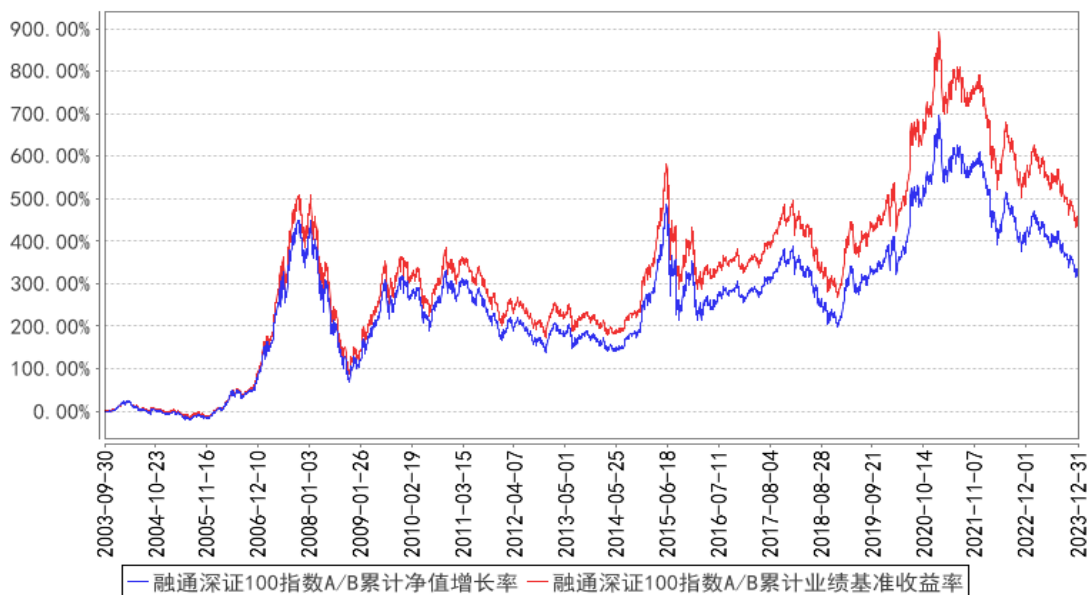
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.95%	0.96%	-6.84%	0.97%	-0.11%	-0.01%
过去六个月	-13.95%	0.96%	-13.73%	0.97%	-0.22%	-0.01%
过去一年	-15.91%	0.94%	-15.25%	0.95%	-0.66%	-0.01%
过去三年	-37.27%	1.29%	-35.53%	1.29%	-1.74%	0.00%
过去五年	42.97%	1.38%	48.26%	1.37%	-5.29%	0.01%
自基金合同生效起至今	334.01%	1.65%	456.97%	1.62%	-122.96%	0.03%

融通深证 100 指数 C

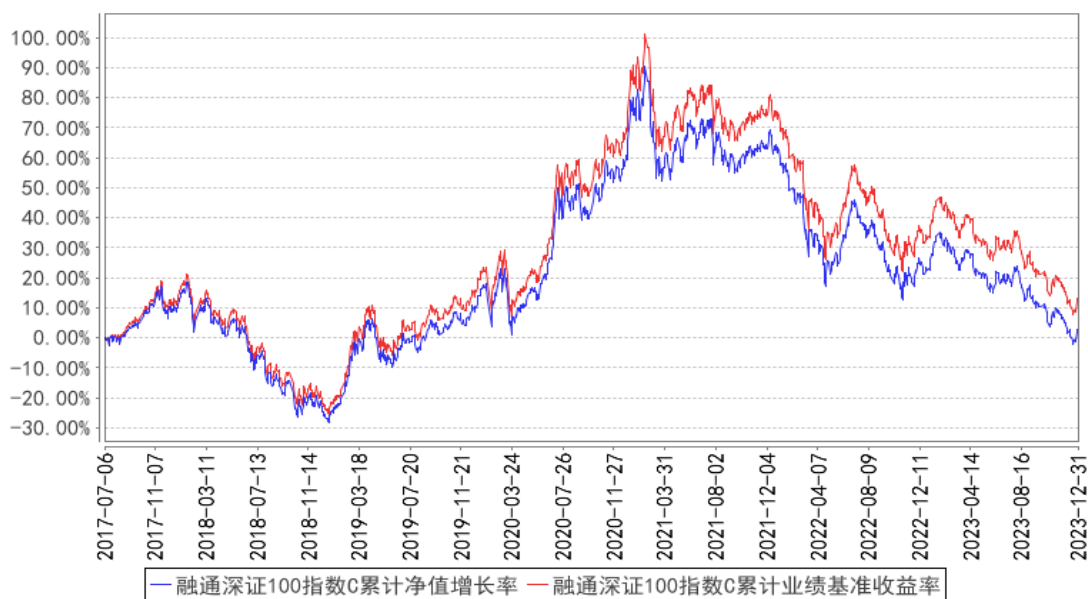
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-7.05%	0.96%	-6.84%	0.97%	-0.21%	-0.01%
过去六个月	-14.06%	0.97%	-13.73%	0.97%	-0.33%	0.00%
过去一年	-16.19%	0.94%	-15.25%	0.95%	-0.94%	-0.01%
过去三年	-37.97%	1.29%	-35.53%	1.29%	-2.44%	0.00%
过去五年	40.23%	1.38%	48.26%	1.37%	-8.03%	0.01%
自基金合同生效起至今	2.67%	1.37%	12.87%	1.36%	-10.20%	0.01%

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

融通深证100指数A/B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



融通深证100指数C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

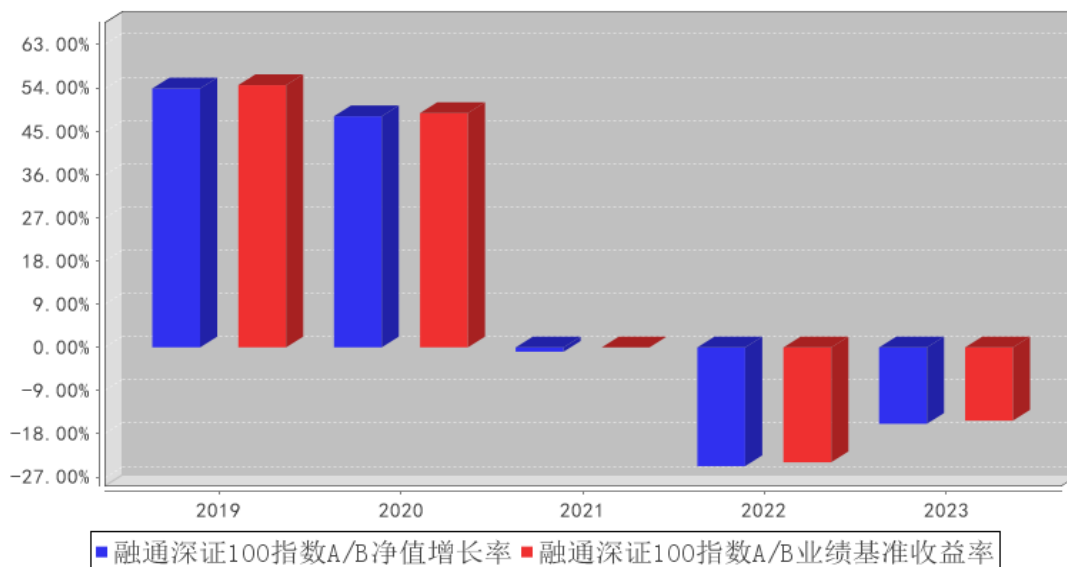


注：1、本基金业绩比较基准项目分段计算，其中：2005年8月21日之前(含此日)采用“深证100指数×75%+银行间债券综合指数×25%”，2005年8月22日起使用新基准即“深证100指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%”。

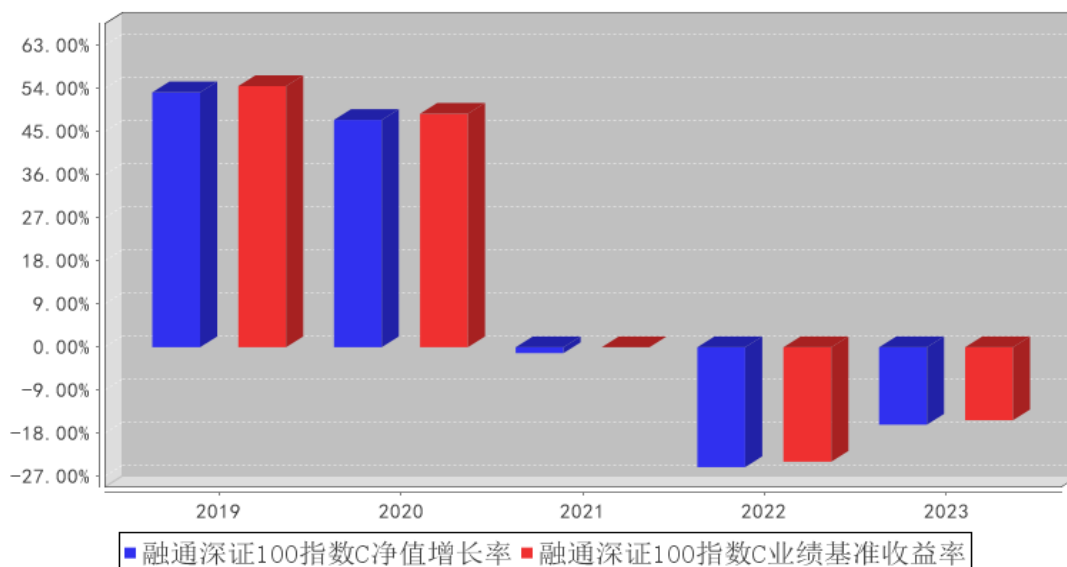
2、本基金于2017年7月5日增加C类份额，C类份额的首次确认日为2017年7月6日，故本基金C类份额的统计区间为2017年7月6日至本报告期末。

3.2.3 过去五年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

融通深证100指数A/B基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



融通深证100指数C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

融通深证 100 指数 A/B

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
2023 年	0.0500	5,934,334.60	10,708,025.46	16,642,360.06	-
2022 年	0.0500	5,342,299.64	10,368,145.74	15,710,445.38	-
2021 年	0.0500	4,995,277.84	10,934,953.65	15,930,231.49	-

合计	0.1500	16,271,912.08	32,011,124.85	48,283,036.93	-
----	--------	---------------	---------------	---------------	---

融通深证 100 指数 C

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
2023 年	0.0500	43,268.71	12,602.26	55,870.97	-
2022 年	0.0500	34,750.47	11,879.84	46,630.31	-
2021 年	0.0500	28,489.35	9,864.64	38,353.99	-
合计	0.1500	106,508.53	34,346.74	140,855.27	-

§ 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：诚通证券股份有限公司 60%、日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co., Ltd.）40%。本基金管理人拥有公募基金管理资格、特定客户（专户）资产管理资格、合格境内机构投资者资格（QDII）、保险资产受托管理资格、人民币合格境内机构投资者（RQDII）资格、合格境内投资企业（QDIE）资格，产品线完备，涵盖主动权益类基金、被动投资类基金、债券基金、货币基金、混合基金、QDII 基金等。

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、指数与量化投资部总经理	2014 年 10 月 25 日	-	15 年	何天翔先生，厦门大学经济学硕士，15 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2008 年 7 月至 2010 年 3 月就职于华泰联合证券有限责任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、指数与量化投资部总监、融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）基金经理、融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理、融通中证军工指数分级证券投资基金基金经理、融通中证精准医疗主题指数证券投资基金（LOF）基金经理、融通通瑞债券型证券投资基金基金经理、融通创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理，现任指数与量化投资部总经理、融

					通深证 100 指数证券投资基金基金经理、融通新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通中证人工智能主题指数证券投资基金 (LOF) 基金经理、融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金 (LOF) 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、基金业务相关的工作时间为计算标准。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

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、10 日内）公司管理的不同投资组合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

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深证 100 指数成份股自然权重的偏离，有效控制跟踪误差，为投资者提供投资深证 100 指数的一个有效工具。

深证 100 指数由深圳交易所 100 只市值大，流动性好的 A 股股票编制而成，为深市核心指数之一，消费和科技的占比较高，前五大权重行业分别为电力设备、电子、医药、食品饮料、家电。

本报告期内，本基金日均跟踪偏离为 0.03%，年化跟踪误差为 0.36%，符合基金合同约定。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通深证 100 指数 A/B 基金份额净值为 1.191 元，本报告期基金份额净值增长率为-15.91%，同期业绩比较基准收益率为-15.25%；

截至本报告期末融通深证 100 指数 C 基金份额净值为 1.161 元，本报告期基金份额净值增长率为-16.19%，同期业绩比较基准收益率为-15.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年国内生产总值 (GDP) 达 126 万亿元，比上年增长 5.2%，高于全球 3% 左右的预计增速，在世界主要经济体中名列前茅，对世界经济增长贡献率有望超 30%，是世界经济增长的最大引擎。其中服务业增加值占 GDP 比重增至 54.6%。2023 年居民消费价格指数 (CPI) 比上年上涨 0.2%，货物出口增长 0.6%，年末外汇储备超 3.2 万亿美元。初步测算，2023 年全社会研究与试验发展 (R&D) 经费投入达 33278.2 亿元，R&D 经费投入强度达 2.64%，比上年提高 0.08 个百分点。总的来看，2023 年我国顶住外部压力、克服内部困难，国民经济回升向好，高质量发展扎实推进。

中央经济工作会议要求，2024 年要坚持稳中求进、以进促稳、先立后破，多出有利于稳预期、稳增长、稳就业的政策，在转方式、调结构、提质量、增效益上积极进取，不断巩固稳中向好的基础。要强化宏观政策逆周期和跨周期调节，继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策，加强政策工具创新和协调配合。

当前证券市场整体估值和盈利增长预期基本匹配，根据 wind 数据显示，2023 年底，沪深 300 指数 TTM 市盈率 11 倍左右，处于成立以来 15% 分位左右，2024 年一致预期增速 13% 左右；中证 500 指数 TTM 市盈率 21 倍左右，处于成立以来 12% 分位左右，2024 年一致预期增速 20% 左右；创业板指数 TTM 市盈率 28 倍左右，处于成立以来 1% 分位左右，2024 年一致预期增速 35% 左右。总的来说，当前整体市场估值不高，一致预期增速不低。

从因子角度看，2023 年价值因子整体表现出色，部分风险因子、流动性因子与高频价量因

子也有表现，而盈利质量类、成长类、分析师类因子则表现不佳。

再看深证 100 指数，近年来深证 100 指数的估值逐步提升，估值中枢也同时提升，根据 wind 数据显示，2023 年底，其 TTM 市盈率 17 倍左右，处于成立以来 18%左右的分位数水平，估值较低，深证 100 指数 2024 年一致预期净利润增长率为 25%左右，市场预期成长性较好。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

基金管理人坚持一切从保护基金持有人利益出发，继续致力于内控制度与机制的完善，加强合规控制与风险防范，确保基金运作符合法律法规和基金合同的要求。公司监察稽核相关部门通过合规审核、实时监控及专项检查等方法，对基金运作和公司管理进行独立的监察稽核，及时发现风险隐患，提出整改建议，并督促跟踪业务部门进行整改。

在专项稽核方面，公司监察稽核相关部门针对不同业务环节的风险特点，制定年度检查计划，并结合对各风险点风险程度的实时判断和评估，按照不同的检查频率，对投资决策、研究支持、交易执行、基金销售、后台运营、信息披露及员工职业操守管理等方面的重点业务环节进行专项检查，检查有关业务执行的合规性和风险控制措施的有效性，检查项目覆盖了相关业务的主要风险点。本报告期内，加大了对投资管理人员管控措施、投资决策流程及决策依据、交易执行及后台运作风险等敏感、重点项目的关注，确保基金运作的稳健合规。

4.7 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基金估值业务原则和程序管理细则》进行，公司设立由研究相关部门、风险管理部、登记清算部、稽核审计部和法律合规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。

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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于 2023 年 1 月 16 日实施 2022 年第 1 次利润分配，以 2022 年 12 月 31 日的可分配收益为基准，融通深证 100 指数 A/B 每 10 份基金份额派发红利 0.0500 元，融通深证 100 指数 C 每 10 份基金份额派发红利 0.0500 元。

本基金于 2024 年 1 月 16 日实施 2023 年第 1 次利润分配，以 2023 年 12 月 31 日的可分配收益为基准，融通深证 100 指数 A/B 每 10 份基金份额派发红利 0.0300 元，融通深证 100 指数 C 每 10 份基金份额派发红利 0.0300 元。

4.9 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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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，本基金的管理人——融通基金管理有限公司在本基金的投资运作、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，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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本基金 2023 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

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 22003 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	融通通利系列证券投资基金之融通深证 100 指数证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	(一) 我们审计的内容 我们审计了融通通利系列证券投资基金之融通深证 100 指数证券投资基金(以下简称“融通深证 100 指数基金”)的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。 (二) 我们的意见

	<p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了融通深证 100 指数基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于融通深证 100 指数基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>融通深证 100 指数基金的基金管理人融通基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估融通深证 100 指数基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算融通深证 100 指数基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督融通深证 100 指数基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对融通深证 100 指数基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露</p>

	<p>不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致融通深证 100 指数基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	沈兆杰	陈邈迤
会计师事务所的地址	中国·上海市	
审计报告日期	2024 年 3 月 26 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：融通通利系列证券投资基金之融通深证 100 指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	237,979,599.56	261,340,078.78
结算备付金		203,724.80	91,956.20
存出保证金		26,172.90	58,347.94
交易性金融资产	7.4.7.2	3,799,189,130.55	4,485,093,633.84
其中：股票投资		3,799,189,130.55	4,485,093,633.84
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,290,217.40	1,101,164.15
递延所得税资产		-	-

其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		4,038,688,845.21	4,747,685,180.91
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末
		2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	14.47
应付赎回款		3,057,309.55	2,312,720.03
应付管理人报酬		3,373,374.20	4,050,480.89
应付托管费		674,674.82	810,096.15
应付销售服务费		5,288.94	5,397.64
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	758,133.78	960,910.87
负债合计		7,868,781.29	8,139,620.05
净资产:			
实收基金	7.4.7.10	3,384,344,620.04	3,335,100,376.50
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	646,475,443.88	1,404,445,184.36
净资产合计		4,030,820,063.92	4,739,545,560.86
负债和净资产总计		4,038,688,845.21	4,747,685,180.91

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 3,384,344,620.04 份，其中融通深证 100 指数 A/B 类基金份额 3,370,650,987.93 份，基金份额净值 1.191 元；融通深证 100 指数 C 类基金份额 13,693,632.11 份，基金份额净值 1.161 元。

7.2 利润表

会计主体：融通通利系列证券投资基金之融通深证 100 指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2023 年 1 月 1 日至	2022 年 1 月 1 日至
		2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-706,915,507.00	-1,431,429,303.76
1. 利息收入		949,607.78	878,125.70
其中：存款利息收入	7.4.7.13	949,607.78	878,125.70
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		39,022,249.74	74,506,578.30
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-31,071,290.84	8,682,605.60
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	576,528.77	1,795,551.26
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	69,517,011.81	64,028,421.44
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-747,146,169.87	-1,507,172,495.44
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	258,805.35	358,487.68
减：二、营业总支出		55,680,784.56	60,444,728.38
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	46,120,789.08	50,087,087.72
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	9,224,157.83	10,017,417.42
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	67,428.53	61,741.07
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		1.12	1.81
8. 其他费用	7.4.7.23	268,408.00	278,480.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-762,596,291.56	-1,491,874,032.14
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-762,596,291.56	-1,491,874,032.14
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-762,596,291.56	-1,491,874,032.14

7.3 净资产变动表

会计主体：融通通利系列证券投资基金之融通深证 100 指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	3,335,100,376.50	-	1,404,445,184.36	4,739,545,560.86
二、本期期初净资产	3,335,100,376.50	-	1,404,445,184.36	4,739,545,560.86
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	49,244,243.54	-	-757,969,740.48	-708,725,496.94
（一）、综合收益总额	-	-	-762,596,291.56	-762,596,291.56
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	49,244,243.54	-	21,324,782.11	70,569,025.65
其中：1. 基金申购款	419,356,988.16	-	159,256,700.05	578,613,688.21
2. 基金赎回款	-370,112,744.62	-	-137,931,917.94	-508,044,662.56
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-16,698,231.03	-16,698,231.03
四、本期期末净资产	3,384,344,620.04	-	646,475,443.88	4,030,820,063.92
项目	上年度可比期间			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	3,141,691,623.21	-	2,806,182,694.24	5,947,874,317.45
二、本期期初净资产	3,141,691,623.21	-	2,806,182,694.24	5,947,874,317.45
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	193,408,753.29	-	-1,401,737,509.88	-1,208,328,756.59
（一）、综合收益总额	-	-	-1,491,874,032.14	-1,491,874,032.14
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	193,408,753.29	-	105,893,597.95	299,302,351.24
其中：1. 基金申购款	570,583,866.20	-	313,220,011.32	883,803,877.52
2. 基金赎回款	-377,175,112.91	-	-207,326,413.37	-584,501,526.28
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-15,757,075.69	-15,757,075.69
四、本期期末净资产	3,335,100,376.50	-	1,404,445,184.36	4,739,545,560.86

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

高翔

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 基金基本情况

融通深证 100 指数证券投资基金(以下简称“本基金”)是融通通利系列证券投资基金(以下简称“本系列基金”)之子基金,本系列基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2003]第 94 号《关于同意融通通利系列证券投资基金设立的批复》核准,由融通基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定(后由《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法规替代)和《融通通利系列证券投资基金基金契约》(后更名为《融通通利系列证券投资基金基金合同》)发起,并于 2003 年 9 月 30 日募集成立。本基金为契约型开放式,存续期限不定,本基金首次设立,包括认购资金利息共募集人民币 477,689,377.16 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第 138 号验资报告予以验证,其中认购资金为人民币 477,610,977.87 元,认购资金产生利息为人民币 78,399.29 元。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《关于融通深证 100 指数证券投资基金增设 H 类基金份额类别并修改基金合同的公告》以及更新的《融通通利系列证券投资基金更新招募说明书》的有关规定,自 2016 年 7 月 14 日起,本基金根据销售对象的不同,将基金份额分为不同的类别。在中国内地销售的、为中国内地投资者设立的份额,称为 A 类基金份额;在中国香港地区销售的、为中国香港投资者设立的份额,称为 H 类基金份额。本基金 A 类基金份额、H 类基金份额单独设置基金代码,分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。除非基金管理人在未来条件成熟后另行公告开通相关业务,本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《关于融通深证 100 指数证券投资基金增设 C 类基金份额并修订基金合同部分条款的公告》以及更新的《融通通利系列证券投资基金更新招募说明书》的有关规定,自 2017 年 7 月 5 日起,本基金根据销售服务费或申购费收取方式的不同以及销售对象的不同将基金份额分为不同的类别。在中国内地销售的、为中国内地投资者设立的,在投资者申购时收取前端申购费用,而不从本类别基金资产中计提销售服务费的份额,称为 A 类基金份额;在中国内地销售的、为中国内地投资者设立的,在投资者赎回时收取后端申购费用,而不从本类别基金资产中计提销售服务费的份额,称为 B 类基金份额;在中国内地销售的、为中国内地投资者设立的,不收取前/后端申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的份额,称为 C 类基金份额;在中国香港地区销售的、为中国香港投资者设立的份额,称为 H 类基金份额。本基金 A/B 类基金份额、C 类基金份额、H 类基金份额单独设置基金代码,分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。除非基

金管理人在未来条件成熟后另行公告开通相关业务,本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。截至 2022 年 12 月 31 日,本基金尚未正式开通 H 类基金份额申赎业务。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通通利系列证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为深证 100 指数成份股和债券,以基金非债券资产 90%以上的资金对深证 100 指数的成份股进行股票指数化投资,其中股票指数化投资部分不得低于基金资产的 50%,相对于深证 100 指数的日跟踪误差不超过 0.5%。本基金标的指数使用费由基金管理人融通基金管理有限公司承担,不计入本基金费用。此外本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的 80%;并保持不低于基金资产净值 5%的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券。本基金业绩比较基准为:深证 100 指数收益率 X 95% + 银行同业存款利率 X 5%。

7.4.2 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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<年度报告和中期报告>》、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》、《融通通利系列证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时,确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最

近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若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,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

根据中国证监会于2024年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	237,979,599.56	261,340,078.78
等于：本金	237,956,355.32	261,314,690.69
加：应计利息	23,244.24	25,388.09
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
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	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	237,979,599.56	261,340,078.78

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	3,490,333,962.72	-	3,799,189,130.55	308,855,167.83
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	3,490,333,962.72	-	3,799,189,130.55	308,855,167.83
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	3,429,092,296.14	-	4,485,093,633.84	1,056,001,337.70
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		3,429,092,296.14	-	4,485,093,633.84	1,056,001,337.70

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00	500,000.00
应付赎回费	5,496.59	5,519.90
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	248,137.19	190,890.97
其中：交易所市场	248,137.19	190,890.97
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	254,500.00	264,500.00
合计	758,133.78	960,910.87

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

融通深证 100 指数 A/B

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,323,648,208.36	3,323,648,208.36
本期申购	402,986,415.63	402,986,415.63
本期赎回（以“-”号填列）	-355,983,636.06	-355,983,636.06
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	3,370,650,987.93	3,370,650,987.93

融通深证 100 指数 C

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,452,168.14	11,452,168.14
本期申购	16,370,572.53	16,370,572.53

本期赎回(以“-”号填列)	-14,129,108.56	-14,129,108.56
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	13,693,632.11	13,693,632.11

注：申购含红利再投及转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

融通深证 100 指数 A/B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,986,476,158.32	-586,500,810.97	1,399,975,347.35
本期期初	1,986,476,158.32	-586,500,810.97	1,399,975,347.35
本期利润	-15,321,100.70	-744,257,147.79	-759,578,248.49
本期基金份额交易产生的变动数	27,972,666.63	-7,451,806.23	20,520,860.40
其中：基金申购款	239,202,372.87	-85,517,543.01	153,684,829.86
基金赎回款	-211,229,706.24	78,065,736.78	-133,163,969.46
本期已分配利润	-16,642,360.06	-	-16,642,360.06
本期末	1,982,485,364.19	-1,338,209,764.99	644,275,599.20

融通深证 100 指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,027,810.38	-1,557,973.37	4,469,837.01
本期期初	6,027,810.38	-1,557,973.37	4,469,837.01
本期利润	-129,020.99	-2,889,022.08	-3,018,043.07
本期基金份额交易产生的变动数	1,165,508.26	-361,586.55	803,921.71
其中：基金申购款	8,521,925.04	-2,950,054.85	5,571,870.19
基金赎回款	-7,356,416.78	2,588,468.30	-4,767,948.48
本期已分配利润	-55,870.97	-	-55,870.97
本期末	7,008,426.68	-4,808,582.00	2,199,844.68

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	946,684.44	869,379.46
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	2,448.98	7,712.23
其他	474.36	1,034.01
合计	949,607.78	878,125.70

注：此处其他列示的是基金交易保证金利息收入。

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至 2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-31,071,290.84	8,682,605.60
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-31,071,290.84	8,682,605.60

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至 2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日 至2022年12月31日
卖出股票成交总额	196,846,570.70	250,449,108.07
减：卖出股票成本总额	227,313,071.82	240,688,888.99
减：交易费用	604,789.72	1,077,613.48
买卖股票差价收入	-31,071,290.84	8,682,605.60

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至 2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
债券投资收益——利息收入	315.40	1,259,201.55
债券投资收益——买卖债券(债转股及 债券到期兑付)差价收入	576,213.37	536,349.71
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	576,528.77	1,795,551.26

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至 2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	3,771,589.11	205,377,030.20
减:卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	3,194,885.06	201,114,047.99
减:应计利息总额	339.69	3,726,532.86
减:交易费用	150.99	99.64
买卖债券差价收入	576,213.37	536,349.71

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	69,517,011.81	64,028,421.44
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	69,517,011.81	64,028,421.44

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-747,146,169.87	-1,507,172,495.44
股票投资	-747,146,169.87	-1,507,070,355.44
债券投资	-	-102,140.00
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
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	-747,146,169.87	-1,507,172,495.44

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	174,296.65	211,854.26
基金转换费收入	84,508.70	146,633.42
合计	258,805.35	358,487.68

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. 基金转换费用包括转换费和补差费，其中本基金与本基金管理人旗下除融通通利系列证券投资基金外的其他基金的转换，不低于转换费的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	130,000.00	140,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	408.00	480.36
账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	268,408.00	278,480.36

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的管理人于 2024 年 1 月 11 日宣告 2023 年度第 1 次分红，向截至 2024 年 1 月 16 日登记在册的全体持有人，按每 10 份 A/B 类基金份额派发红利 0.0300 元，按每 10 份 C 类基金份额派发红利 0.0300 元。

7.4.9 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
诚通证券股份有限公司（“诚通证券”）	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（“融通资本”）	本基金管理人能实施重大影响的联营企业
融通国际资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、融通资本为融通基金持有 52.575% 股权比例的基金管理公司子公司。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	46,120,789.08	50,087,087.72
其中：应支付销售机构的客户维护费	21,855,351.03	23,791,532.13
应支付基金管理人的净管理费	24,265,438.05	26,295,555.59

注：1、支付基金管理人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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% / \text{当年天数}。$$

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	9,224,157.83	10,017,417.42

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通深证 100 指数 A/B	融通深证 100 指数 C	合计
融通基金	-	10,403.15	10,403.15
中国工商银行	-	270.74	270.74
合计	-	10,673.89	10,673.89
获得销售服务费的各关	上年度可比期间		

关联方名称	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通深证 100 指数 A/B	融通深证 100 指数 C	合计
融通基金	-	7,978.61	7,978.61
中国工商银行	-	-	-
合计	-	7,978.61	7,978.61

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	237,979,599.56	946,684.44	261,340,078.78

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

融通深证 100 指数 A/B							
序号	权益登记日	除息日	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	本期利润分配合计	备注
1	2023 年 1 月 16 日	2023 年 1 月 16 日	0.050	5,934,334.60	10,708,025.46	16,642,360.06	-
合计	-	-	0.050	5,934,334.60	10,708,025.46	16,642,360.06	-
融通深证 100 指数 C							
序号	权益登记日	除息日	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	本期利润分配合计	备注
1	2023 年 1 月 16 日	2023 年 1 月 16 日	0.050	43,268.71	12,602.26	55,870.97	-
合计	-	-	0.050	43,268.71	12,602.26	55,870.97	-

注：本基金的管理人于 2024 年 1 月 11 日宣告 2023 年度第 1 次分红，向截至 2024 年 1 月 16 日登记在册的全体持有人，按每 10 份 A/B 类基金份额派发红利 0.0300 元，按每 10 份 C 类基金份额派发红利 0.0300 元。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
001239	永达股份	2023 年 12 月 4 日	1-6 个月（含）	首发流通受限	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001306	夏厦精密	2023 年 11 月 9 日	1-6 个月（含）	首发流通受限	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
001326	联域股份	2023 年 11 月 1 日	1-6 个月（含）	首发流通受限	41.18	48.64	99	4,076.82	4,815.36	-
001358	兴欣新材	2023 年 12 月 14 日	1-6 个月（含）	首发流通受限	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
001378	德冠新材	2023 年 10 月 23 日	1-6 个月（含）	首发流通受限	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	-

300904	威力传动	2023年8月2日	1-6个月(含)	首发流通受限	35.41	61.53	304	10,764.64	18,705.12	-
301172	君逸数码	2023年7月19日	1-6个月(含)	首发流通受限	31.33	38.16	438	13,722.54	16,714.08	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	1-6个月(含)	首发流通受限	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301210	金杨股份	2023年6月21日	1-6个月(含)	首发流通受限	57.88	45.48	281	16,264.28	12,779.88	-
301251	威尔高	2023年8月30日	1-6个月(含)	首发流通受限	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1-6个月(含)	首发流通受限	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
301272	英华特	2023年7月6日	1-6个月(含)	首发流通受限	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-
301291	明阳电气	2023年6月21日	1-6个月(含)	首发流通受限	38.13	28.36	1,206	45,984.78	34,202.16	-
301292	海科新源	2023年6月29日	1-6个月(含)	首发流通受限	19.99	19.35	583	11,654.17	11,281.05	-
301329	信音电子	2023年7月5日	1-6个月(含)	首发流通受限	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301348	蓝箭电子	2023年8月1日	1-6个月(含)	首发流通受限	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-
301362	民爆光电	2023年7月27日	1-6个月(含)	首发流通受限	51.05	38.52	420	21,441.00	16,178.40	-
301370	国科恒泰	2023年7月3日	1-6个月(含)	首发流通受限	13.39	16.01	1,240	16,603.60	19,852.40	-
301371	敷尔佳	2023年7月24日	1-6个月(含)	首发流通受限	55.68	37.58	564	31,403.52	21,195.12	-
301381	赛维时代	2023年7月5日	1-6个月(含)	首发流通受限	20.45	29.69	571	11,676.95	16,952.99	-
301393	昊帆生物	2023年7月5日	1-6个月(含)	首发流通受限	67.68	59.37	260	17,596.80	15,436.20	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	1-6个月(含)	首发流通受限	26.68	18.69	520	13,873.60	9,718.80	-
301413	安培龙	2023年12月11日	1-6个月(含)	首发流通受限	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301418	协昌科技	2023年8月10日	1-6个月(含)	首发流通受限	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-
301421	波长光电	2023年8月16日	1-6个月(含)	首发流通受限	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	-
301456	盘古智能	2023年7月6日	1-6个月(含)	首发流通受限	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-

301459	丰茂股份	2023 年 12 月 6 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
301468	博盈特焊	2023 年 7 月 12 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	47.58	30.22	598	28,452.84	18,071.56	-
301469	恒达新材	2023 年 8 月 10 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	57.66	47.25	482	27,792.12	22,774.50	-
301487	盟固利	2023 年 8 月 1 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58	-
301489	思泉新材	2023 年 10 月 16 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
301498	乖宝宠物	2023 年 8 月 9 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	39.99	38.81	554	22,154.46	21,500.74	-
301499	维科精密	2023 年 7 月 13 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-
301500	飞南资源	2023 年 9 月 13 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-
301505	苏州规划	2023 年 7 月 12 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301507	民生健康	2023 年 8 月 24 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
301508	中机认检	2023 年 11 月 23 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
301509	金凯生科	2023 年 7 月 26 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	56.56	62.23	266	15,044.96	16,553.18	-
301510	固高科技	2023 年 8 月 4 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301511	德福科技	2023 年 8 月 8 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	28.00	22.67	491	13,748.00	11,130.97	-
301515	港通医疗	2023 年 7 月 13 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-
301516	中远通	2023 年 12 月 1 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301517	陕西华达	2023 年 10 月 9 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301518	长华化学	2023 年 7 月 26 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-
301519	舜禹	2023 年 7 月	1-6 个月	首发流	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-

	股份	月 19 日	(含)	通受限						
301520	万邦医药	2023 年 9 月 18 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-
301525	儒竞科技	2023 年 8 月 23 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36	-
301526	国际复材	2023 年 12 月 19 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-
301528	多浦乐	2023 年 8 月 17 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-
301529	福赛科技	2023 年 8 月 31 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
301533	威马农机	2023 年 8 月 7 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-
301548	崇德科技	2023 年 9 月 11 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-
301550	斯菱股份	2023 年 9 月 6 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-
301555	惠柏新材	2023 年 10 月 24 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301558	三态股份	2023 年 9 月 21 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-
301559	中集环科	2023 年 9 月 26 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	24.22	18.24	1,315	31,849.30	23,985.60	-
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301568	思泰克	2023 年 11 月 21 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
301578	辰奕智能	2023 年 12 月 21 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金。本基金主要投资于目标指数的成份股票，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似，预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。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风险管理制度，并对风险管理决策和风险管理制度执行情况进行检查、评估和报告。

监察稽核相关部门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。

7.4.13.2 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人中国工商银行，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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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 2023 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2022 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 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 2023 年 12 月 31 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(净资产)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。

7.4.13.3.1 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》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%, 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%(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上述比例限制)。

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, 部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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%。于 2023 年 12 月 31 日, 本基金持有的流动性受限资产的估值未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。于 2023 年 12 月 31 日, 本基金最后交易日的组合资产中 7 个工作日可变现资产账面金额与净赎回金额符合上述法规要求。

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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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、结算备付金和存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	237,979,599.56	-	-	-	237,979,599.56
结算备付金	203,724.80	-	-	-	203,724.80
存出保证金	26,172.90	-	-	-	26,172.90
交易性金融资产	-	-	-	3,799,189,130.55	3,799,189,130.55
应收申购款	-	-	-	1,290,217.40	1,290,217.40
资产总计	238,209,497.26	-	-	3,800,479,347.95	4,038,688,845.21
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,057,309.55	3,057,309.55
应付管理人报酬	-	-	-	3,373,374.20	3,373,374.20
应付托管费	-	-	-	674,674.82	674,674.82
应付销售服务费	-	-	-	5,288.94	5,288.94
其他负债	-	-	-	758,133.78	758,133.78
负债总计	-	-	-	7,868,781.29	7,868,781.29
利率敏感度缺口	238,209,497.26	-	-	3,792,610,566.66	4,030,820,063.92
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	261,340,078.78	-	-	-	261,340,078.78
结算备付金	91,956.20	-	-	-	91,956.20

存出保证金	58,347.94	-	-	-	58,347.94
交易性金融资产	-	-	-	-4,485,093,633.84	4,485,093,633.84
应收申购款	-	-	-	1,101,164.15	1,101,164.15
资产总计	261,490,382.92	-	-	-4,486,194,797.99	4,747,685,180.91
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,312,720.03	2,312,720.03
应付管理人报酬	-	-	-	4,050,480.89	4,050,480.89
应付托管费	-	-	-	810,096.15	810,096.15
应付清算款	-	-	-	14.47	14.47
应付销售服务费	-	-	-	5,397.64	5,397.64
其他负债	-	-	-	960,910.87	960,910.87
负债总计	-	-	-	8,139,620.05	8,139,620.05
利率敏感度缺口	261,490,382.92	-	-	-4,478,055,177.94	4,739,545,560.86

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2022 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2022 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金运用指数化投资方式，通过控制股票投资组合与深证 100 指数的跟踪误差，力求实现对深证 100 指数的有效跟踪。风险管理部负责对基金组合的跟踪误差和风险进行评估，定期提交组合跟踪误差和风险监控报告。在跟踪误差超过一定范围时，通知基金经理和相关部门，及时进行投资组合的调整。投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施。监察稽核部对投资的决策和执行过程进行日常监督。

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、债券的比例不低于本基金资产总值的 80%；并保持不低于基金资产净值 5%的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 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	3,799,189,130.55	94.25	4,485,093,633.84	94.63
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	3,799,189,130.55	94.25	4,485,093,633.84	94.63

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除深证 100 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 (2023 年 12 月 31 日)	上年度末 (2022 年 12 月 31 日)
	深证 100 指数收益率上升 5%	190,245,780.62	223,609,233.71
	深证 100 指数收益率下降 5%	-190,245,780.62	-223,609,233.71

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次, 由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位: 人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	3,798,369,374.85	4,484,181,120.63
第二层次	-	-
第三层次	819,755.70	912,513.21
合计	3,799,189,130.55	4,485,093,633.84

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

<p>本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。</p> <p>对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。</p>
--

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	912,513.21	912,513.21
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,216,591.73	2,216,591.73
转出第三层次	-	1,853,774.80	1,853,774.80
当期利得或损失总额	-	-455,574.44	-455,574.44
其中：计入损益的利得或损失	-	-455,574.44	-455,574.44
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	819,755.70	819,755.70
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	100,859.23	100,859.23
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计

	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,025,949.06	1,025,949.06
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,298,329.31	2,298,329.31
转出第三层次	-	1,873,620.23	1,873,620.23
当期利得或损失总额	-	-538,144.93	-538,144.93
其中：计入损益的利得或损失	-	-538,144.93	-538,144.93
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	912,513.21	912,513.21
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	19,232.73	19,232.73

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于 2023 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	819,755.70	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	14.62%~217.52%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	912,513.21	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	18.91%~247.56%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	3,799,189,130.55	94.07
	其中：股票	3,799,189,130.55	94.07
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	238,183,324.36	5.90
8	其他各项资产	1,316,390.30	0.03
9	合计	4,038,688,845.21	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	144,558,210.28	3.59
B	采矿业	20,253,703.60	0.50
C	制造业	2,894,829,509.09	71.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,166,305.00	0.45
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	24,179,554.92	0.60
G	交通运输、仓储和邮政业	68,048,669.60	1.69
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	108,629,538.68	2.69
J	金融业	323,098,478.04	8.02
K	房地产业	57,193,602.86	1.42
L	租赁和商务服务业	46,767,892.56	1.16
M	科学研究和技术服务业	37,857,163.95	0.94
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	44,393,815.06	1.10
R	文化、体育和娱乐业	10,242,792.00	0.25
S	综合	-	-

	合计	3,798,219,235.64	94.23
--	----	------------------	-------

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	861,340.96	0.02
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	56,342.59	0.00
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	16,714.08	0.00
J	金融业	-	-
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	26,564.46	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	8,932.82	0.00
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	969,894.91	0.02

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 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

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	1,704,046	278,202,549.96	6.90
2	000333	美的集团	3,481,920	190,217,289.60	4.72
3	000858	五粮液	1,220,396	171,233,762.76	4.25
4	300059	东方财富	8,507,573	119,446,324.92	2.96
5	002594	比亚迪	569,945	112,849,110.00	2.80
6	002475	立讯精密	3,229,422	111,253,587.90	2.76
7	300760	迈瑞医疗	356,612	103,631,447.20	2.57
8	000651	格力电器	2,954,522	95,046,972.74	2.36
9	002415	海康威视	2,691,540	93,450,268.80	2.32
10	000568	泸州老窖	516,190	92,614,809.80	2.30
11	300124	汇川技术	1,314,245	82,981,429.30	2.06
12	000725	京东方 A	20,421,303	79,643,081.70	1.98

13	300498	温氏股份	3,665,253	73,524,975.18	1.82
14	002714	牧原股份	1,724,945	71,033,235.10	1.76
15	002352	顺丰控股	1,539,274	62,186,669.60	1.54
16	300274	阳光电源	686,800	60,156,812.00	1.49
17	002230	科大讯飞	1,250,231	57,985,713.78	1.44
18	000063	中兴通讯	2,143,840	56,768,883.20	1.41
19	000001	平安银行	5,706,178	53,581,011.42	1.33
20	000625	长安汽车	3,080,739	51,848,837.37	1.29
21	002142	宁波银行	2,461,292	49,496,582.12	1.23
22	300122	智飞生物	792,619	48,436,947.09	1.20
23	000338	潍柴动力	3,486,836	47,595,311.40	1.18
24	300308	中际旭创	419,961	47,417,796.51	1.18
25	002027	分众传媒	7,399,983	46,767,892.56	1.16
26	002304	洋河股份	424,850	46,691,015.00	1.16
27	002050	三花智控	1,536,814	45,182,331.60	1.12
28	000100	TCL 科技	10,379,904	44,633,587.20	1.11
29	300015	爱尔眼科	2,806,183	44,393,815.06	1.10
30	002371	北方华创	175,500	43,122,105.00	1.07
31	002466	天齐锂业	715,400	39,912,166.00	0.99
32	000002	万 科 A	3,778,905	39,527,346.30	0.98
33	300014	亿纬锂能	894,027	37,727,939.40	0.94
34	000661	长春高新	245,656	35,816,644.80	0.89
35	000792	盐湖股份	2,201,481	35,113,621.95	0.87
36	002241	歌尔股份	1,668,843	35,062,391.43	0.87
37	002460	赣锋锂业	776,690	33,242,332.00	0.82
38	300782	卓胜微	233,762	32,960,442.00	0.82
39	002129	TCL 中环	2,021,300	31,613,132.00	0.78
40	002049	紫光国微	460,179	31,039,073.55	0.77
41	002179	中航光电	736,106	28,708,134.00	0.71
42	000776	广发证券	1,950,266	27,869,301.14	0.69
43	000166	申万宏源	6,065,069	26,928,906.36	0.67
44	300142	沃森生物	1,110,456	26,106,820.56	0.65
45	300408	三环集团	882,380	25,986,091.00	0.64
46	000963	华东医药	583,202	24,179,554.92	0.60
47	000538	云南白药	485,826	23,878,347.90	0.59
48	002236	大华股份	1,287,062	23,746,293.90	0.59
49	002311	海大集团	523,500	23,510,385.00	0.58
50	002493	荣盛石化	2,250,550	23,293,192.50	0.58
51	000938	紫光股份	1,164,859	22,540,021.65	0.56
52	000596	古井贡酒	94,231	21,936,976.80	0.54
53	000768	中航西飞	961,717	21,513,609.29	0.53
54	002459	晶澳科技	1,030,492	21,351,794.24	0.53
55	002920	德赛西威	164,375	21,288,206.25	0.53

56	002709	天赐材料	845,214	21,197,967.12	0.53
57	300347	泰格医药	383,085	21,058,182.45	0.52
58	300033	同花顺	129,400	20,298,978.00	0.50
59	000983	山西焦煤	2,049,970	20,253,703.60	0.50
60	300661	圣邦股份	224,906	20,018,883.06	0.50
61	002001	新和成	1,167,490	19,800,630.40	0.49
62	002555	三七互娱	1,036,700	19,500,327.00	0.48
63	000157	中联重科	2,985,488	19,495,236.64	0.48
64	002812	恩捷股份	340,931	19,371,699.42	0.48
65	300450	先导智能	741,302	18,977,331.20	0.47
66	300896	爱美客	63,626	18,727,040.58	0.46
67	000895	双汇发展	683,303	18,251,023.13	0.45
68	001979	招商蛇口	1,853,752	17,666,256.56	0.44
69	002601	龙佰集团	1,026,203	17,578,857.39	0.44
70	002821	凯莱英	150,980	17,528,778.00	0.43
71	003816	中国广核	5,604,300	17,429,373.00	0.43
72	300316	晶盛机电	388,200	17,115,738.00	0.42
73	300759	康龙化成	579,675	16,798,981.50	0.42
74	002736	国信证券	1,925,152	16,440,798.08	0.41
75	300433	蓝思科技	1,243,118	16,409,157.60	0.41
76	000425	徐工机械	2,841,900	15,516,774.00	0.38
77	000786	北新建材	660,100	15,419,936.00	0.38
78	002180	纳思达	589,200	13,333,596.00	0.33
79	300751	迈为股份	95,860	12,414,828.60	0.31
80	002271	东方雨虹	635,703	12,205,497.60	0.30
81	002603	以岭药业	511,900	11,809,533.00	0.29
82	002841	视源股份	249,657	11,424,304.32	0.28
83	002410	广联达	643,185	11,024,190.90	0.27
84	300999	金龙鱼	326,614	10,902,375.32	0.27
85	300454	深信服	145,800	10,539,882.00	0.26
86	300413	芒果超媒	406,460	10,242,792.00	0.25
87	000301	东方盛虹	1,047,781	10,058,697.60	0.25
88	301269	华大九天	90,500	9,579,425.00	0.24
89	300628	亿联网络	316,160	9,342,528.00	0.23
90	002916	深南电路	130,580	9,269,874.20	0.23
91	000876	新希望	986,924	9,198,131.68	0.23
92	000617	中油资本	1,673,440	9,036,576.00	0.22
93	002938	鹏鼎控股	385,300	8,599,896.00	0.21
94	000708	中信特钢	559,698	7,858,159.92	0.19
95	300979	华利集团	140,714	7,407,184.96	0.18
96	001965	招商公路	600,000	5,862,000.00	0.15
97	300919	中伟股份	115,000	5,649,950.00	0.14
98	001289	龙源电力	37,200	736,932.00	0.02

99	300957	贝泰妮	9,100	620,347.00	0.02
----	--------	-----	-------	------------	------

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301566	达利凯普	5,755	162,891.85	0.00
2	301526	国际复材	9,723	43,267.35	0.00
3	301487	盟固利	867	35,512.32	0.00
4	301291	明阳电气	1,206	34,202.16	0.00
5	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00
6	301559	中集环科	1,315	23,985.60	0.00
7	301486	致尚科技	482	22,774.50	0.00
8	301525	儒竞科技	266	21,668.36	0.00
9	301498	乖宝宠物	554	21,500.74	0.00
10	301371	敷尔佳	564	21,195.12	0.00
11	301370	国科恒泰	1,240	19,852.40	0.00
12	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
13	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
14	300904	威力传动	304	18,705.12	0.00
15	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
16	301468	博盈特焊	598	18,071.56	0.00
17	301381	赛维时代	571	16,952.99	0.00
18	301172	君逸数码	438	16,714.08	0.00
19	301509	金凯生科	266	16,553.18	0.00
20	301362	民爆光电	420	16,178.40	0.00
21	301393	昊帆生物	260	15,436.20	0.00
22	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
23	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
24	301210	金杨股份	281	12,779.88	0.00
25	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
26	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
27	301292	海科新源	583	11,281.05	0.00
28	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
29	301511	德福科技	491	11,130.97	0.00
30	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
31	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
32	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
33	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
34	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
35	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
36	301395	仁信新材	520	9,718.80	0.00
37	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
38	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
39	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00

40	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
41	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
42	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
43	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
44	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
45	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
46	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
47	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
48	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
49	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
50	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
51	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
52	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
53	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
54	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
55	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
56	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
57	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
58	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
59	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
60	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
61	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00

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	300308	中际旭创	46,891,106.71	0.99
2	300750	宁德时代	39,172,241.00	0.83
3	000983	山西焦煤	20,149,006.19	0.43
4	300760	迈瑞医疗	14,275,374.00	0.30
5	002603	以岭药业	13,594,735.00	0.29
6	301269	华大九天	11,397,165.00	0.24
7	002920	德赛西威	11,061,710.00	0.23
8	300751	迈为股份	8,076,614.00	0.17
9	000661	长春高新	7,828,418.00	0.17
10	002050	三花智控	7,429,245.00	0.16
11	002555	三七互娱	7,378,138.00	0.16
12	001965	招商公路	5,965,745.00	0.13
13	300763	锦浪科技	5,605,466.00	0.12
14	002459	晶澳科技	5,082,381.60	0.11
15	002180	纳思达	4,931,565.00	0.10
16	300124	汇川技术	4,918,933.00	0.10
17	000938	紫光股份	4,715,757.00	0.10

18	002352	顺丰控股	4,522,845.00	0.10
19	000617	中油资本	4,395,336.00	0.09
20	300979	华利集团	4,321,087.00	0.09

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	000858	五粮液	23,210,542.00	0.49
2	000661	长春高新	17,776,697.00	0.38
3	002202	金风科技	16,082,139.84	0.34
4	002271	东方雨虹	14,976,796.00	0.32
5	000069	华侨城 A	9,741,819.44	0.21
6	300601	康泰生物	9,022,088.94	0.19
7	000651	格力电器	8,782,120.00	0.19
8	002414	高德红外	8,373,381.74	0.18
9	300763	锦浪科技	7,182,674.00	0.15
10	000568	泸州老窖	6,530,335.43	0.14
11	300122	智飞生物	6,405,960.00	0.14
12	002410	广联达	6,150,571.00	0.13
13	000002	万科 A	5,403,842.00	0.11
14	000876	新希望	4,927,251.00	0.10
15	300059	东方财富	4,914,295.00	0.10
16	300274	阳光电源	4,860,674.00	0.10
17	300957	贝泰妮	4,170,911.00	0.09
18	300015	爱尔眼科	4,116,697.60	0.09
19	002352	顺丰控股	3,965,952.00	0.08
20	002594	比亚迪	3,181,319.00	0.07

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	288,554,738.40
卖出股票收入（成交）总额	196,846,570.70

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

无。

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

无。

8.7 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

无。

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

无。

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

无。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

无。

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	26,172.90
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,290,217.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,316,390.30

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	301526	国际复材	43,267.35	0.00	首发流通受限
2	301487	盟固利	35,512.32	0.00	首发流通受限
3	301291	明阳电气	34,202.16	0.00	首发流通受限
4	301348	蓝箭电子	27,321.41	0.00	首发流通受限
5	301566	达利凯普	12,752.64	0.00	首发流通受限

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 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

份额级别	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 (%)
融通深证 100 指数 A/B	259,615	12,983.27	30,432,834.96	0.90	3,340,218,152.97	99.10
融通深证 100 指数 C	3,101	4,415.88	-	-	13,693,632.11	100.00
合计	262,716	12,882.14	30,432,834.96	0.90	3,353,911,785.08	99.10

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	融通深证 100 指数 A/B	1,149,525.47	0.03410
	融通深证 100 指数 C	1,600.54	0.01169
	合计	1,151,126.01	0.03401

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情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	融通深证 100 指数 A/B	10~50
	融通深证 100 指数 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	融通深证 100 指数 A/B	10~50
	融通深证 100 指数 C	0
	合计	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通深证 100 指数 A/B	融通深证 100 指数 C
基金合同生效日（2003 年 9 月 30 日）基金份额总额	477,689,377.16	-
本报告期期初基金份额总额	3,323,648,208.36	11,452,168.14
本报告期基金总申购份额	402,986,415.63	16,370,572.53
减：本报告期基金总赎回份额	355,983,636.06	14,129,108.56
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	3,370,650,987.93	13,693,632.11

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

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 基金管理人的重大人事变动

1、2023 年 1 月 20 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，本公司首席信息官由 Allen Yan（颜锡廉）变更为高翔，上述变更事项经本公司董事会审议通过。

2、2023 年 3 月 14 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，新任杜国彦为公司副总经理，上述变更事项经本公司董事会审议通过。

3、2023 年 4 月，经本公司股东会表决通过，由江涛先生担任公司董事，吕秋梅女士不再担任公司董事。

4、2023 年 4 月 28 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，新任商小虎为公司副总经理，上述变更事项经本公司董事会审议通过。

5、2023 年 4 月 28 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员

变更的公告》，新任王智鲲为公司财务负责人，上述变更事项经本公司董事会审议通过。

11.2.2 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。

11.3 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。

11.4 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。

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），该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。本基金本年度应支付的审计费用为人民币 130,000.00 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

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人及相关高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2023 年 12 月 18 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会深圳监管局
受到的具体措施类型	责令改正等相关行政监管措施
受到稽查或处罚等措施的原因	未严格执行相关法规规定，内部控制机制不健全
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	管理人高度重视，已按法律法规和监管要求对相关 问题进行了全面整改，并已将整改落实情况报送监 管机构。

11.6.2 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，本基金的基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 (%)	
长江证券	1	233,520,056.41	49.57	218,552.24	49.87	-
浙商证券	1	62,328,822.91	13.23	57,424.03	13.10	-
中泰证券	3	59,738,949.27	12.68	55,037.82	12.56	-
申万宏源	1	58,017,537.06	12.31	54,255.96	12.38	-

华西证券	1	57,509,980.84	12.21	52,983.66	12.09	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
野村东方 证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中信证券 (山东)	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五个方面：

- 1) 实力雄厚，信誉良好；内部管理规范，严格；注册资本符合证监会相关要求；
- 2) 研究实力较强，有稳定的研究机构和专业的研究人员，能及时为本公司提供高质量的研究支持与服务，包括宏观与策略报告、行业与公司分析报告、债券市场分析报告和金融衍生品分析报告等，并能根据基金投资的特定需求，提供专门研究报告；
- 3) 券商利用其他专业研究咨询机构为本公司提供研究与支持服务的，对该券商研究方面的要求按照上述第 2 点规定执行；
- 4) 严格禁止将席位开设与券商的基金销售挂钩；
- 5) 严格禁止向券商承诺基金在交易单元上的交易量。

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) 评价券商。投资研究相关部门对拟合作券商的研究质量与研究服务进行评价；
- 2) 拟定合作券商。投资研究相关部门根据券商选择标准，拟定备选合作券商；
- 3) 上报批准。投资研究相关部门将备选合作券商上报至研究部，由研究部将备选合作券商

的情况上报公司批准；

4) 签署协议。在获得批准后，研究部依据公司合同审批流程，与确定的券商签约。

3、交易单元变更情况

本报告期内，安信证券更名为国投证券，新增国泰君安证券交易单元 1 个。

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(%)
长江证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	3,771,589.11	54.14	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	3,194,900.00	45.86	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
野村东方 证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券 (山东)	-	-	-	-	-	-

11.8 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	融通基金关于网上直销平台费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 7 日
2	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在部分销售机构开通转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 10 日
3	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在部分销售机构开通定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 10 日
4	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在上海天天、北京中植开通转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 10 日
5	融通通利系列证券投资基金之融通深证 100 指数证券投资基金第二十六次分红公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 11 日
6	融通基金管理有限公司关于提醒投资者注意防范不法分子冒用“融通基金”名义进行诈骗活动的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 19 日
7	关于融通旗下部分基金增加招商银行股份有限公司招赢通为销售平台并开展费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 20 日
8	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 20 日
9	关于融通基金管理有限公司旗下部分基金增加招商银行股份有限公司招赢通为销售平台并开通转换业务及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 6 日
10	关于旗下部分开放式基金新增海通证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参与其前端申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 20 日
11	融通基金管理有限公司关于提醒投资者注意防范不法分子诈骗活动的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 27 日
12	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增博时财富基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 6 日
13	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 14 日
14	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金在腾安基金销售（深圳）有限公司开通转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 17 日

15	融通基金管理有限公司关于公司董事变更情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 14 日
16	关于旗下部分开放式基金新增华宝证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 18 日
17	关于旗下部分开放式基金新增诚通证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 19 日
18	关于旗下部分开放式基金新增中国中金财富证券有限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 21 日
19	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 28 日
20	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 28 日
21	关于旗下部分开放式基金新增中国工商银行股份有限公司为销售机构并开通转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 18 日
22	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加珠海盈米基金销售有限公司转换费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 22 日
23	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增上海万得基金销售有限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 7 月 6 日
24	关于旗下部分开放式基金在金元证券股份有限公司开通定期定额投资、转换业务及参加申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 8 月 28 日
25	《融通通利系列证券投资基金基金合同》修改前后文对照表	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 11 月 6 日
26	融通基金关于网上直销平台费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 12 月 12 日
27	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增上海陆享基金销售有限公司为销售机构并开通转换业务及参与其费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 12 月 28 日

§ 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

无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准融通通利系列证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通通利系列证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通通利系列证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通通利系列证券投资基金招募说明书》及其更新
- (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

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

13.3 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，或登录本基金管理人网站 <http://www.rtfund.com> 查阅。

融通基金管理有限公司

2024 年 3 月 28 日