

融通内需驱动股票型证券投资基金 2012 年年度报告摘要

2012 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：2013 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据融通内需驱动股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)基金合同规定，于 2013 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有限公司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 2012 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	融通内需驱动股票
基金主代码	161611
前端交易代码	161611
后端交易代码	161661
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 4 月 22 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	606,105,500.59 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于由国内投资需求和消费需求所驱动的优势企业，分享中国经济增长及增长方式转变所带来的收益，实现基金资产可持续的稳定增值。
投资策略	本基金重点投资于由国内投资需求和消费需求所驱动的优势企业，根据经济演进的规律和产业变迁的路径，“自上而下”确定资产配置与行业配置比例，在行业配置下“自下而上”精选个股。本基金股票资产主要投资于治理规范、经营稳健、财务良好和盈利能力强的内需驱动型的优秀公司，但是，只有满足“规范、独特、简单、成长”特性的龙头公司才有可能成为我们的核心资产，对这部分资产，我们将长期持有，充分分享中国经济长期高速增长和企业做大做强所带来的巨大收益。

业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中信标普全债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于高风险高收益的基金品种，其收益和风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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
	联系电话	(0755) 26948666
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com
客户服务电话	400-883-8088、(0755) 26948088	95588
传真	(0755) 26935005	(010) 66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	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

§ 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	2012 年	2011 年	2010 年
本期已实现收益	-122,316,197.69	-98,134,113.31	74,816,357.90
本期利润	39,763,384.78	-255,368,397.85	-30,553,590.43
加权平均基金份额本期利润	0.0644	-0.4015	-0.0377
本期基金份额净值增长率	10.67%	-40.20%	-4.06%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末	2011 年末	2010 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.3264	-0.3906	0.0393
期末基金资产净值	408,276,533.50	380,052,058.67	700,844,739.63
期末基金份额净值	0.674	0.609	1.039

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

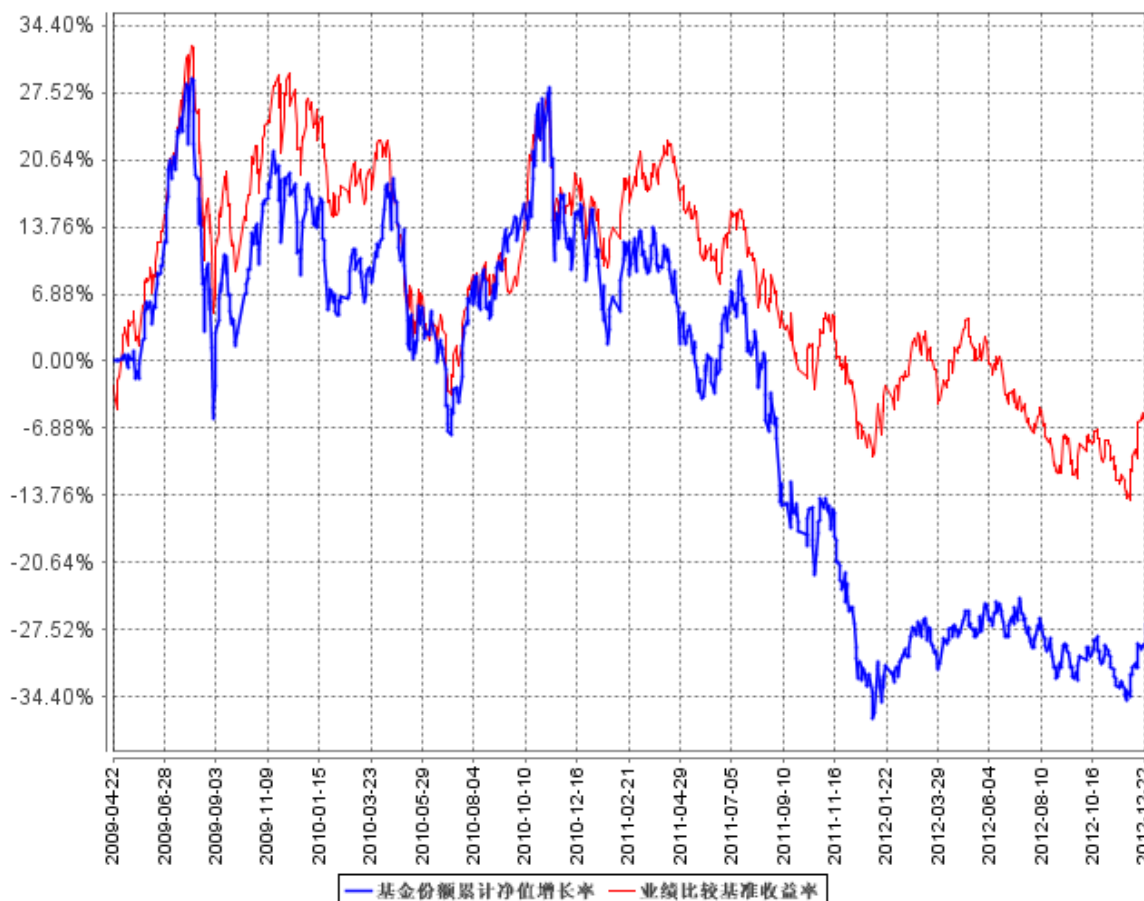
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	7.50%	1.00%	8.24%	1.03%	-0.74%	-0.03%

过去六个月	3.06%	1.02%	2.37%	0.99%	0.69%	0.03%
过去一年	10.67%	1.17%	7.18%	1.02%	3.49%	0.15%
过去三年	-36.50%	1.44%	-21.99%	1.12%	-14.51%	0.32%
自基金合同生效起至今	-24.94%	1.51%	-0.99%	1.22%	-23.95%	0.29%

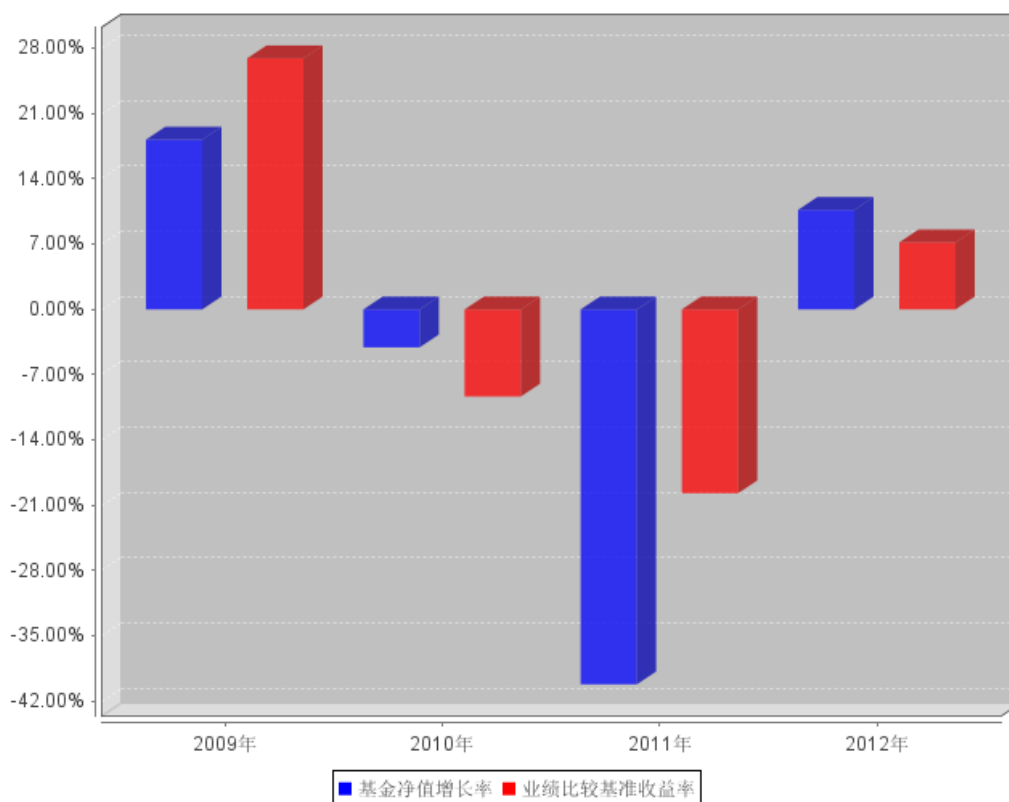
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：上图所示 2009 年度数据统计期为 2009 年 4 月 22 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日，未按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2012	-	-	-	-	
2011	0.200	5,802,746.84	7,468,274.37	13,271,021.21	
2010	-	-	-	-	
合计	0.200	5,802,746.84	7,468,274.37	13,271,021.21	

§ 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：新时代证券有限责任公司60%、日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co., Ltd.）40%。

截至2012年12月31日，公司管理的基金共有十六只：一只封闭式基金，即融通通乾封闭基金；十五只开放式基金，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）、融通易支付货币基金、融通动力先锋股票基金、融通领先成长股票基金（LOF）、融通内需驱动股票基金、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、融通医疗保健行业股票基金和融

通岁岁添利定期开放债券基金。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		
周珺	本基金的基金经理	2012 年 1 月 5 日	-	5	硕士研究生，具有基金从业资格，4 年证券和证券投资基金从业经验。2008 年 3 月至今，就职于融通基金管理有限公司，从事宏观策略研究、行业研究、周期性研究工作。
鲁万峰	本基金的基金经理	2009 年 4 月 22 日	2012 年 1 月 19 日	18	经济学博士，具有证券从业资格。曾就职于北京华融投资管理有限公司和中国人保资产管理有限公司，从事研究和投资工作，2006 年 6 月至今就职于融通基金管理有限公司，任职基金管理部总监助理。

注：任职日期和离任日期根据基金管理人对外披露的任职日期填写；证券从业年限以从事证券业务相关的工作时间为计算标准；

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《融通内需驱动股票型证券投资基金基金合同》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。基金投资组合符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金本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

2012 年中国经济充分演绎了自身的特点，那就是对政策的极端依赖和对房地产行业的极端敏感。2012 年初，A 股市场出现了典型的春季躁动行情，在以稀土为首的煤炭、有色带动下，大盘

一季度大幅反弹。但很快房地产限购的影响在二季度初显现，各行业景气程度均先后回落，虽个股仍保持一定活跃度，但指数受拖累较大。在经济低迷的状态下，各地方政府对房地产政策的隐形放松及适度微调使得投资者对房地产的经济支柱地位深信不疑，地产也成为 2012 年度少有的行情持续全年的板块，重配地产的基金在全年收益颇丰。随着房地产回暖和中央在年中大规模批复的轨道、环保等项目的落实，进入四季度 A 股市场才在金融、汽车、家电等早周期行业的带动下走出凌厉的反弹行情。

纵观全年，在经济低迷时，虽经多方努力，房地产仍然成为解决地方财政问题、中下游景气的唯一途径。而一旦经济企稳，房地产又成为最敏感的区域，销量和房价很快形成正反馈，从而成为制约政策松动程度和未来经济预期的掣肘。也就是说，虽然中国经济正在为扩大内需和新兴城镇化而努力，但现实残酷证明我们尚无法有效走出房地产——财源——投资拉动的旧有循环模式。而且房地产这一支柱和掣肘利器估计短时间内仍将强有力地影响中国经济。

本基金全年较好地把握了房地产这一中枢行业，同时判断由于经济的正循环尚未形成，因此四季度前控制了整体仓位，投资策略不激进，在行业选择中也以对经济不敏感的大消费和部分成长空间较大的中等市值成长股为主。挖掘了一些为组合带来较大正贡献的个股，从而获得了较好的配置效果。四季度，本基金发现大量反映经济内生动力的板块走势与大盘出现了背离，从而判断短期情绪和流动性导致的下跌步入尾声，继而提高了仓位并增加了银行、汽车、保险等行业的比例，较好追随了大盘上涨的节奏。遗憾的是，本基金在白酒股上的投资出现了一些错误，全年也遭遇了一些个股的非系统性风险释放，为净值造成了损失。

总体而言，本基金在配置基础上力求把握市场的主要矛盾，以竞争结构良好的传统行业龙头和优质的成长股为组合的主要方向。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为 10.67%，同期业绩比较基准收益率为 7.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

近期市场扭转了近三年来的颓势，一举站上年线，似乎又看到了小牛市的曙光。本基金认为在有能见度的一季度，市场有望保持惯性上涨。市场就像物理学中具备动能的物体，趋势一旦形成，除非出现连续的外力，否则很难停止惯性运动。而目前市场中有可能改变既有趋势的外力需要观察两会召开前后的资金供需和经济真实复苏程度。

但是，本基金认为，中国经济还没有摆脱房地产——财源——投资拉动的旧有循环模式，因此瓶颈是显而易见的。新兴城镇化是未来的发展方向和解决问题的途径之一，但需要时间积累和检验。故而，我们将此轮行情仍然定义为反弹，但享受泡沫和情绪的浪花本身就是投资的传统模式之一，因此，本基金会在保持仓位中性的基础上增加组合的弹性，以更多享受市场活跃度和风险偏好提升的大金融和估值弹性更大、业绩能稳定较快增长的优质成长股为主，力争取得较好的配置效果。

中期而言，本基金会以新兴城镇化为未来一段时间的主要投资线索，积极寻找符合这一方向的细分行业龙头进行投资。同时传统产业中能够持续做大，并在竞争结构好转过程中享受稳定盈利能力和增长的优质公司也会获得稳定收益，它们虽不是中国经济的活力所在，但却是这个市场的中流砥柱。

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、金融工程小组、登记清算部和监察稽核部指定人员共同组成的估值委员会，通过参考行业协会估值意见、参考独立第三方机构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验，估值委员会成员不包含基金经理。

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、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计算每日基金净值，每日对基金所投资品种的公开信息、基金会计估值方法的法规等进行搜集并整理汇总，供估值委员会参考，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。基金经理不参与估值决定，参与估值流程各方之间亦不存在任何重大利益冲突，截至报告期末公司未与外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至 2012 年 12 月 31 日，本基金每基金份额可供分配利润为-0.3264 元，依据基金合同的约定，不进行利润分配。

§ 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

2012 年，本基金托管人在对融通内需驱动股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2012 年，融通内需驱动股票型证券投资基金的管理人——融通基金管理有限公司在融通内需驱动股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，融通内需驱动股票型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对融通基金管理有限公司编制和披露的融通内需驱动股票型证券投资基金 2012 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

本基金 2012 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有限公司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(2013)第 20524 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：融通内需驱动股票型证券投资基金

报告截止日：2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	48,555,557.69	8,054,110.66
结算备付金	2,131,588.94	1,729,655.12
存出保证金	3,443,250.59	2,268,968.43
交易性金融资产	336,311,437.12	368,671,398.09
其中：股票投资	316,339,437.12	349,345,398.09

基金投资	-	-
债券投资	19,972,000.00	19,326,000.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	20,000,425.95	-
应收利息	197,159.88	87,141.91
应收股利	-	-
应收申购款	81,591.80	1,000,779.90
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	410,721,011.97	381,812,054.11
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2012年12月31日	2011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	-	-
应付赎回款	250,334.06	118,806.30
应付管理人报酬	484,135.92	506,454.68
应付托管费	80,689.34	84,409.11
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,074,006.09	495,679.97
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	555,313.06	554,645.38
负债合计	2,444,478.47	1,759,995.44
所有者权益:		
实收基金	606,105,500.59	623,624,594.15
未分配利润	-197,828,967.09	-243,572,535.48
所有者权益合计	408,276,533.50	380,052,058.67
负债和所有者权益总计	410,721,011.97	381,812,054.11

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.674 元，基金份额总额 606,105,500.59 元。

7.2 利润表

会计主体：融通内需驱动股票型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011
-----	----------------------------	---------------------------------

	年 12 月 31 日	年 12 月 31 日
一、收入	56,470,747.47	-239,541,125.80
1. 利息收入	1,203,743.40	1,349,427.21
其中：存款利息收入	486,635.83	309,906.31
债券利息收入	669,695.10	1,039,520.90
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	47,412.47	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益	-106,829,734.35	-83,762,405.17
其中：股票投资收益	-111,024,738.73	-88,572,984.42
基金投资收益	-	-
债券投资收益	60.00	-683,740.00
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	4,194,944.38	5,494,319.25
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	162,079,582.47	-157,234,284.54
4. 汇兑收益	-	-
5. 其他收入	17,155.95	106,136.70
减：二、费用	16,707,362.69	15,827,272.05
1. 管理人报酬	5,887,201.99	8,347,755.19
2. 托管费	981,200.38	1,391,292.50
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	9,470,040.37	5,719,214.36
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	368,919.95	369,010.00
三、利润总额	39,763,384.78	-255,368,397.85
减：所得税费用	-	-
四、净利润（	39,763,384.78	-255,368,397.85

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

项目	本期 2012 年度		
	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)	623,624,594.15	-243,572,535.48	380,052,058.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	39,763,384.78	39,763,384.78
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-17,519,093.56	5,980,183.61	-11,538,909.95
其中：1. 基金申购款	37,455,256.14	-13,907,103.69	23,548,152.45
2. 基金赎回款	-54,974,349.70	19,887,287.30	-35,087,062.40
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)	606,105,500.59	-197,828,967.09	408,276,533.50
项目	上年度可比期间		
	2011 年度		
	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)	674,373,314.75	26,471,424.88	700,844,739.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-255,368,397.85	-255,368,397.85
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-50,748,720.60	-1,404,541.30	-52,153,261.90
其中：1. 基金申购款	95,217,031.52	-11,920,836.67	83,296,194.85
2. 基金赎回款	-145,965,752.12	10,516,295.37	-135,449,456.75
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-13,271,021.21	-13,271,021.21
五、期末所有者权益(基金净值)	623,624,594.15	-243,572,535.48	380,052,058.67

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

奚星华
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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

7.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
融通基金管理有限公司	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、基金代销机构
新时代证券有限责任公司(“新时代证券”)	基金管理人股东、基金代销机构
日兴资产管理有限公司	基金管理人股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未租用关联方的交易单元。

7.4.4.1 关联方报酬

7.4.4.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,887,201.99	8,347,755.19
其中：支付销售机构的客户维护费	1,525,968.12	2,159,020.49

注：支付基金管理人融通基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 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：

日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

7.4.4.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	981, 200. 38	1, 391, 292. 50

注：支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0. 25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0. 25%/当年天数。

7. 4. 4. 2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7. 4. 4. 3 各关联方投资本基金的情况

7. 4. 4. 3. 1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7. 4. 4. 3. 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

本报告期末，基金管理人的主要股东及其控制的机构未持有本基金份额。

7. 4. 4. 4 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日		2011 年 1 月 1 日至 2011 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	48, 555, 557. 69	445, 272. 03	8, 054, 110. 66	279, 448. 98

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7. 4. 4. 5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金本报告期和上年度可比期间均未买入管理人、托管人的控股股东在承销期内担任副主承销商或分销商所承销的证券；

2、本基金本报告期和上年度可比期间均未买入管理人、托管人的主要股东（非控股）在承销期承销的证券。

7. 4. 4. 6 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项的说明。

7. 4. 5 期末（2012 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7. 4. 5. 1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

7. 4. 5. 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
000002	万科A	12/12/26	B 股 转 H 股	10. 62	13/1/21	11. 13	1, 500, 000	12, 879, 144. 18	15, 930, 000. 00	-
合计								12, 879, 144. 18	15, 930, 000. 00	

注：本基金截至 2012 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。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因从事银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因从事交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

§ 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	316,339,437.12	77.02
	其中：股票	316,339,437.12	77.02
2	固定收益投资	19,972,000.00	4.86
	其中：债券	19,972,000.00	4.86
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	50,687,146.63	12.34
6	其他各项资产	23,722,428.22	5.78
7	合计	410,721,011.97	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	4,114,000.00	1.01
B	采掘业	13,958,090.60	3.42
C	制造业	138,780,601.21	33.99
C0	食品、饮料	10,451,000.00	2.56
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	7,746,350.00	1.90
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	24,192,216.49	5.93
C5	电子	14,599,328.50	3.58
C6	金属、非金属	19,419,300.00	4.76
C7	机械、设备、仪表	32,751,406.22	8.02
C8	医药、生物制品	29,621,000.00	7.26
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	3,518,326.80	0.86
H	批发和零售贸易	8,629,389.89	2.11

I	金融、保险业	79,273,500.00	19.42
J	房地产业	44,239,735.74	10.84
K	社会服务业	20,375,792.88	4.99
L	传播与文化产业	3,450,000.00	0.85
M	综合类	-	-
	合计	316,339,437.12	77.48

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000538	云南白药	298,000	20,264,000.00	4.96
2	600104	上汽集团	970,000	17,110,800.00	4.19
3	000002	万科A	1,500,000	15,930,000.00	3.90
4	300070	碧水源	391,000	15,679,100.00	3.84
5	600036	招商银行	1,110,000	15,262,500.00	3.74
6	601318	中国平安	300,000	13,587,000.00	3.33
7	601166	兴业银行	800,000	13,352,000.00	3.27
8	600030	中信证券	900,000	12,024,000.00	2.95
9	002236	大华股份	249,910	11,583,328.50	2.84
10	600519	贵州茅台	50,000	10,451,000.00	2.56

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人融通基金管理有限公司网站（<http://www.rtfund.com>）的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601601	中国太保	48,884,145.04	12.86
2	600809	山西汾酒	43,962,877.24	11.57
3	600111	包钢稀土	43,749,076.17	11.51
4	601318	中国平安	43,455,442.28	11.43
5	600048	保利地产	42,874,939.51	11.28
6	600031	三一重工	41,901,933.89	11.03
7	600585	海螺水泥	41,405,363.47	10.89
8	000024	招商地产	37,075,165.51	9.76
9	601166	兴业银行	36,980,681.74	9.73
10	000858	五粮液	36,796,730.08	9.68
11	000776	广发证券	35,737,535.74	9.40
12	600104	上汽集团	35,129,721.36	9.24

13	600157	永泰能源	34,513,816.73	9.08
14	002106	莱宝高科	32,733,188.32	8.61
15	601336	新华保险	32,435,253.59	8.53
16	600030	中信证券	32,406,364.28	8.53
17	002081	金螳螂	32,064,108.39	8.44
18	600519	贵州茅台	30,934,237.96	8.14
19	002230	科大讯飞	30,827,420.35	8.11
20	000562	宏源证券	30,527,812.43	8.03
21	601699	潞安环能	30,025,927.82	7.90
22	000423	东阿阿胶	29,767,627.05	7.83
23	000002	万科A	29,680,911.25	7.81
24	600837	海通证券	27,315,917.97	7.19
25	600036	招商银行	26,206,303.01	6.90
26	601628	中国人寿	25,717,669.31	6.77
27	002456	欧菲光	25,692,005.22	6.76
28	000157	中联重科	25,672,043.85	6.75
29	000538	云南白药	25,491,592.83	6.71
30	600694	大商股份	25,446,851.45	6.70
31	600801	华新水泥	24,608,453.77	6.48
32	000568	泸州老窖	24,483,214.13	6.44
33	600498	烽火通信	24,453,041.63	6.43
34	600887	伊利股份	24,167,690.94	6.36
35	600016	民生银行	24,067,520.98	6.33
36	600518	康美药业	24,041,461.59	6.33
37	600395	盘江股份	23,606,508.47	6.21
38	002304	洋河股份	23,567,028.08	6.20
39	002450	康得新	23,419,379.85	6.16
40	002477	雏鹰农牧	23,341,168.93	6.14
41	000789	江西水泥	23,240,818.08	6.12
42	002146	荣盛发展	23,021,781.57	6.06
43	600720	祁连山	22,423,515.53	5.90
44	000651	格力电器	22,095,647.03	5.81
45	300146	汤臣倍健	22,058,439.16	5.80
46	000069	华侨城A	20,908,649.81	5.50
47	000338	潍柴动力	20,176,038.99	5.31
48	300070	碧水源	20,078,292.38	5.28

49	002325	洪涛股份	19,933,720.58	5.24
50	600587	新华医疗	19,742,604.73	5.19
51	002285	世联地产	19,137,291.97	5.04
52	002273	水晶光电	19,042,993.26	5.01
53	000528	柳 工	19,004,880.36	5.00
54	000527	美的电器	17,703,321.62	4.66
55	601117	中国化学	17,112,078.09	4.50
56	002415	海康威视	16,892,211.37	4.44
57	002241	歌尔声学	16,615,124.47	4.37
58	300104	乐视网	16,373,894.92	4.31
59	600015	华夏银行	16,193,518.77	4.26
60	600383	金地集团	16,160,639.22	4.25
61	000401	冀东水泥	15,944,411.63	4.20
62	300115	长盈精密	15,800,761.00	4.16
63	002236	大华股份	15,697,664.70	4.13
64	000661	长春高新	15,112,878.63	3.98
65	000799	酒 鬼 酒	15,070,540.47	3.97
66	600315	上海家化	14,957,430.68	3.94
67	601169	北京银行	14,920,918.54	3.93
68	600109	国金证券	14,654,419.27	3.86
69	600123	兰花科创	14,442,331.63	3.80
70	600547	山东黄金	14,197,980.48	3.74
71	600141	兴发集团	14,079,628.97	3.70
72	002024	苏宁电器	14,021,539.18	3.69
73	600559	老白干酒	13,820,264.06	3.64
74	600085	同仁堂	13,808,168.77	3.63
75	601088	中国神华	13,763,461.51	3.62
76	002073	软控股份	13,604,593.74	3.58
77	600166	福田汽车	13,596,186.41	3.58
78	300197	铁汉生态	13,398,974.32	3.53
79	600750	江中药业	13,239,688.32	3.48
80	600458	时代新材	12,975,227.02	3.41
81	300101	国腾电子	12,807,196.97	3.37
82	600535	天士力	12,616,855.20	3.32
83	002055	得润电子	12,490,360.47	3.29
84	002292	奥飞动漫	12,137,558.53	3.19

85	000581	威孚高科	12,089,478.93	3.18
86	000888	峨眉山 A	12,086,114.76	3.18
87	601766	中国南车	12,060,339.76	3.17
88	000998	隆平高科	11,922,118.79	3.14
89	601566	九牧王	11,917,148.08	3.14
90	300079	数码视讯	11,862,898.37	3.12
91	002353	杰瑞股份	11,732,974.06	3.09
92	000028	国药一致	11,667,987.58	3.07
93	002447	壹桥苗业	11,427,304.06	3.01
94	002157	正邦科技	11,207,510.89	2.95
95	600546	山煤国际	11,147,841.47	2.93
96	002503	搜于特	10,867,693.60	2.86
97	000012	南玻 A	10,792,951.25	2.84
98	600309	烟台万华	10,729,244.81	2.82
99	600422	昆明制药	10,615,527.42	2.79
100	300058	蓝色光标	10,580,503.60	2.78
101	002271	东方雨虹	10,468,054.21	2.75
102	601918	国投新集	10,467,055.98	2.75
103	300005	探路者	10,391,510.32	2.73
104	600059	古越龙山	10,250,041.28	2.70
105	000625	长安汽车	10,247,637.54	2.70
106	300285	国瓷材料	10,208,390.69	2.69
107	000650	仁和药业	10,022,212.71	2.64
108	600702	沱牌舍得	9,997,978.22	2.63
109	000826	桑德环境	9,939,619.91	2.62
110	000983	西山煤电	9,760,855.93	2.57
111	002037	久联发展	9,712,977.42	2.56
112	002306	湘鄂情	9,513,604.99	2.50
113	601888	中国国旅	9,156,847.99	2.41
114	600436	片仔癀	9,139,499.91	2.40
115	601666	平煤股份	9,124,278.41	2.40
116	600425	青松建化	8,865,835.00	2.33
117	300124	汇川技术	8,545,904.38	2.25
118	300113	顺网科技	8,515,376.00	2.24
119	600489	中金黄金	8,500,186.17	2.24
120	300228	富瑞特装	8,451,639.79	2.22

121	600138	中青旅	8,413,856.30	2.21
122	002294	信立泰	8,280,504.06	2.18
123	000430	张家界	8,168,203.42	2.15
124	600066	宇通客车	8,135,888.27	2.14
125	002250	联化科技	8,051,343.96	2.12
126	600582	天地科技	8,017,747.16	2.11
127	300171	东富龙	7,936,854.70	2.09
128	300026	红日药业	7,906,854.33	2.08
129	002233	塔牌集团	7,899,505.00	2.08
130	600859	王府井	7,726,121.91	2.03
131	000823	超声电子	7,718,205.00	2.03
132	002594	比亚迪	7,703,352.62	2.03
133	600028	中国石化	7,693,600.00	2.02

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	600585	海螺水泥	65,306,068.82	17.18
2	000776	广发证券	53,777,074.23	14.15
3	600030	中信证券	53,109,682.48	13.97
4	600801	华新水泥	44,775,696.24	11.78
5	600809	山西汾酒	44,271,494.42	11.65
6	600048	保利地产	44,102,797.32	11.60
7	601601	中国太保	43,816,896.13	11.53
8	600837	海通证券	43,605,940.20	11.47
9	600111	包钢稀土	41,784,344.42	10.99
10	600031	三一重工	41,360,558.54	10.88
11	600395	盘江股份	38,580,241.15	10.15
12	600750	江中药业	37,744,572.79	9.93
13	000858	五粮液	36,021,764.37	9.48
14	000661	长春高新	35,259,933.81	9.28
15	000024	招商地产	34,442,131.54	9.06
16	000983	西山煤电	34,225,803.44	9.01
17	002230	科大讯飞	33,703,702.80	8.87
18	002106	莱宝高科	33,543,983.57	8.83
19	601699	潞安环能	33,459,877.22	8.80
20	601888	中国国旅	33,172,039.49	8.73

21	601336	新华保险	32,534,124.94	8.56
22	002081	金螳螂	31,907,116.75	8.40
23	600157	永泰能源	31,850,717.82	8.38
24	601318	中国平安	30,544,783.24	8.04
25	000423	东阿阿胶	29,579,735.64	7.78
26	000562	宏源证券	29,123,218.75	7.66
27	002456	欧菲光	26,701,030.09	7.03
28	601166	兴业银行	25,932,712.96	6.82
29	600348	阳泉煤业	25,655,955.38	6.75
30	000568	泸州老窖	25,315,776.13	6.66
31	000157	中联重科	24,905,405.20	6.55
32	002450	康得新	24,782,001.89	6.52
33	600694	大商股份	24,289,526.30	6.39
34	600887	伊利股份	24,240,619.20	6.38
35	000789	江西水泥	23,795,545.46	6.26
36	600720	祁连山	23,556,243.16	6.20
37	600498	烽火通信	23,200,840.88	6.10
38	002304	洋河股份	22,900,171.22	6.03
39	600104	上汽集团	22,749,004.71	5.99
40	600518	康美药业	22,552,793.91	5.93
41	000069	华侨城 A	22,444,002.36	5.91
42	000651	格力电器	22,265,793.01	5.86
43	300146	汤臣倍健	22,178,680.74	5.84
44	601628	中国人寿	22,171,373.20	5.83
45	000937	冀中能源	21,502,535.33	5.66
46	600376	首开股份	21,036,124.99	5.54
47	002325	洪涛股份	20,807,623.97	5.47
48	002285	世联地产	19,859,602.87	5.23
49	000783	长江证券	19,453,069.11	5.12
50	600519	贵州茅台	19,329,436.05	5.09
51	002477	雏鹰农牧	19,083,789.94	5.02
52	000338	潍柴动力	18,932,178.19	4.98
53	002273	水晶光电	18,772,297.72	4.94
54	000528	柳 工	18,706,399.63	4.92
55	600267	海正药业	18,003,032.55	4.74
56	600425	青松建化	17,371,488.44	4.57
57	000799	酒 鬼 酒	17,230,376.39	4.53
58	000527	美的电器	16,957,907.62	4.46

59	000002	万 科A	16,869,527.54	4.44
60	601169	北京银行	16,584,539.23	4.36
61	002415	海康威视	16,483,529.67	4.34
62	300104	乐视网	16,289,744.68	4.29
63	300115	长盈精密	15,590,423.23	4.10
64	600315	上海家化	15,217,502.81	4.00
65	000401	冀东水泥	15,197,419.80	4.00
66	600015	华夏银行	15,161,568.13	3.99
67	600559	老白干酒	15,050,074.92	3.96
68	002146	荣盛发展	14,852,793.95	3.91
69	600141	兴发集团	14,718,253.27	3.87
70	600109	国金证券	14,407,132.94	3.79
71	600016	民生银行	14,375,000.00	3.78
72	600166	福田汽车	14,258,372.49	3.75
73	600123	兰花科创	14,240,606.41	3.75
74	300251	光线传媒	14,116,849.89	3.71
75	600036	招商银行	14,045,953.12	3.70
76	002241	歌尔声学	14,002,408.39	3.68
77	600085	同仁堂	13,941,550.64	3.67
78	002024	苏宁电器	13,362,666.64	3.52
79	600458	时代新材	13,145,340.74	3.46
80	601117	中国化学	13,004,871.63	3.42
81	300197	铁汉生态	12,928,334.33	3.40
82	000581	威孚高科	12,772,916.46	3.36
83	002073	软控股份	12,761,113.09	3.36
84	600547	山东黄金	12,750,143.10	3.35
85	300101	国腾电子	12,637,120.25	3.33
86	601766	中国南车	12,585,372.50	3.31
87	600587	新华医疗	12,581,047.31	3.31
88	002055	得润电子	12,552,190.43	3.30
89	000998	隆平高科	12,343,206.38	3.25
90	000028	国药一致	12,049,782.75	3.17
91	000888	峨眉山A	11,931,707.74	3.14
92	000686	东北证券	11,832,662.22	3.11
93	601566	九牧王	11,799,631.31	3.10
94	300079	数码视讯	11,394,126.60	3.00
95	002292	奥飞动漫	11,366,427.68	2.99
96	002353	杰瑞股份	11,316,013.19	2.98

97	600422	昆明制药	11,291,710.87	2.97
98	002503	搜于特	11,267,770.95	2.96
99	002447	壹桥苗业	11,117,463.35	2.93
100	002157	正邦科技	10,970,727.23	2.89
101	601918	国投新集	10,827,837.07	2.85
102	300005	探路者	10,731,145.87	2.82
103	000012	南玻A	10,697,708.20	2.81
104	000826	桑德环境	10,663,041.53	2.81
105	600702	沱牌舍得	10,405,598.35	2.74
106	000625	长安汽车	10,363,782.44	2.73
107	300285	国瓷材料	10,255,795.76	2.70
108	600059	古越龙山	10,182,036.44	2.68
109	601088	中国神华	10,075,304.27	2.65
110	002306	湘鄂情	9,826,746.60	2.59
111	300026	红日药业	9,755,114.04	2.57
112	002037	久联发展	9,644,996.57	2.54
113	000538	云南白药	9,519,663.75	2.50
114	600489	中金黄金	9,348,500.56	2.46
115	000650	仁和药业	9,323,903.01	2.45
116	300228	富瑞特装	9,283,531.37	2.44
117	601666	平煤股份	9,083,628.48	2.39
118	600436	片仔癀	8,744,916.13	2.30
119	300113	顺网科技	8,460,433.49	2.23
120	000430	张家界	8,139,842.52	2.14
121	600138	中青旅	7,992,049.88	2.10
122	002594	比亚迪	7,968,590.19	2.10
123	002481	双塔食品	7,965,871.69	2.10
124	000926	福星股份	7,964,668.35	2.10
125	600546	山煤国际	7,889,024.83	2.08
126	600859	王府井	7,852,945.38	2.07
127	600582	天地科技	7,846,445.41	2.06
128	300058	蓝色光标	7,836,076.87	2.06
129	002038	双鹭药业	7,821,108.19	2.06
130	600066	宇通客车	7,773,519.56	2.05
131	601299	中国北车	7,715,999.43	2.03
132	600383	金地集团	7,704,780.06	2.03
133	000823	超声电子	7,683,117.35	2.02
134	002233	塔牌集团	7,655,156.58	2.01

注：“卖出金额”是指卖出股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,070,848,956.77
卖出股票收入（成交）总额	3,154,894,161.48

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,972,000.00	4.89
	其中：政策性金融债	19,972,000.00	4.89
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	19,972,000.00	4.89

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	120238	12 国开 38	200,000	19,972,000.00	4.89

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本基金投资的前十名证券中报告期内无发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.2 本基金投资的前十名股票中，无投资于基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.9.3 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	3,443,250.59
2	应收证券清算款	20,000,425.95
3	应收股利	-
4	应收利息	197,159.88
5	应收申购款	81,591.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	23,722,428.22
---	----	---------------

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十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	000002	万科A	15,930,000.00	3.90	B股转H股

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
19,772	30,654.74	527,520.07	0.09%	605,577,980.52	99.91%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	987,066.20	0.1629%

注：1. 本报告期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间：10-50 万份（含）；

2. 本报告期末本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间：0。

§ 10 开放式基金份额变动

基金合同生效日（2009年4月22日）基金份额总额	2,955,174,216.52
本报告期期初基金份额总额	623,624,594.15
本报告期基金总申购份额	37,455,256.14
减：本报告期基金总赎回份额	54,974,349.70
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	606,105,500.59

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期末召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 本报告期基金管理人的重大人事变更

1) 自 2012 年 1 月 5 日起，增聘周珺先生担任本基金的基金经理，与鲁万峰先生共同管理本基金。

具体内容请参阅 2012 年 1 月 7 日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上发布的相关公告。

2) 自 2012 年 1 月 19 日起，鲁万峰先生因工作需要调入机构理财部工作，不再担任本基金的基金经理，周珺先生继续担任本基金的基金经理，管理本基金。

具体内容请参阅 2012 年 1 月 20 日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上刊登的相关公告。

(2) 本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变更

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内无诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所有限公司，该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务，本年度应支付的审计费用为 50,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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	2	4,186,572,684.57	67.24%	3,550,358.84	66.38%	-
第一创业	1	1,070,813,554.54	17.20%	949,801.11	17.76%	-
长城证券	1	968,356,879.14	15.56%	848,333.63	15.86%	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的标准包括以下六个方面：

- (1) 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

(6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

2、选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的程序包括以下四个步骤：

- (1) 券商服务评价；
- (2) 拟定租用对象。由研究部根据以上评价结果拟定备选的券商；
- (3) 上报批准。研究部将拟定租用对象上报分管副总经理批准；
- (4) 签约。在获得批准后，按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

3、交易单元变更情况

本报告期内新增中山证券 2 个交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	247,000,000.00	77.19%	-	-
长城证券	-	-	73,000,000.00	22.81%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-

融通基金管理有限公司
二〇一三年三月二十九日