

融通动力先锋股票型证券投资基金 2013 年年度报告摘要

2013 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：2014 年 3 月 27 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据融通动力先锋股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)基金合同规定，于 2014 年 3 月 20 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 2013 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	融通动力先锋股票
基金主代码	161609
前端交易代码	161609
后端交易代码	161659
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 11 月 15 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	1,912,960,238.06 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为主动式股票型基金，主要投资于制造业和服务行业中价值暂时被市场低估的股票，分享中国工业化深化过程中两大推动经济增长的引擎——“制造业（特别是装备制造业）和服务业（特别是现代服务业）”的高速成长，力争在控制风险并保持良好流动性的前提下，追求稳定的、优于业绩基准的回报，为投资者实现基金资产
------	--

	稳定且丰厚的长期资本增值。
投资策略	价值低估和业绩增长是推动股价上涨的核心动力。在股价波动与上市公司基本面相关性日益密切的资本市场上，投资于推动经济增长的主要产业部门，可分享该产业部门成长性持续优于经济整体水平而获得的较为显著的超额收益。我们相信，在中国工业化深化阶段，作为经济主要推动力的制造业（特别是装备制造业）和服务业（特别是现代服务业），将是高速发展的产业领域，其增长速度将持续高于 GDP 增长速度。这两个行业中的价值成长型上市公司兼具良好的盈利性和成长性，长期成长前景良好，代表着中国经济增长的方向，是推动经济增长的中坚力量。本基金通过投资于制造业和服务业两大领域中价值暂时被市场低估的股票，分享中国经济和资本市场高速成长硕果，以获取丰厚的资产增值机会。
业绩比较基准	2013 年 6 月 30 日之前（含此日）：富时中国 A600 指数收益率×80%+新华巴克莱资本中国全债指数收益率×20%； 2013 年 7 月 1 日起：沪深 300 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%
风险收益特征	属高风险高收益产品。

注：富时中国 A600 指数即原新华富时 A600 指数。

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	2013 年	2012 年	2011 年
本期已实现收益	302,976,476.45	-203,005,637.73	-439,002,172.68
本期利润	379,045,825.92	47,341,377.56	-834,916,541.81
加权平均基金份额本期利润	0.2012	0.0246	-0.4052
本期基金份额净值增长率	21.36%	2.62%	-30.77%
3.1.2 期末数据和指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末

期末可供分配基金份额利润	-0.1632	-0.3243	-0.2185
期末基金资产净值	2,183,717,533.17	1,752,361,795.59	1,819,395,020.19
期末基金份额净值	1.142	0.941	0.917

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）。

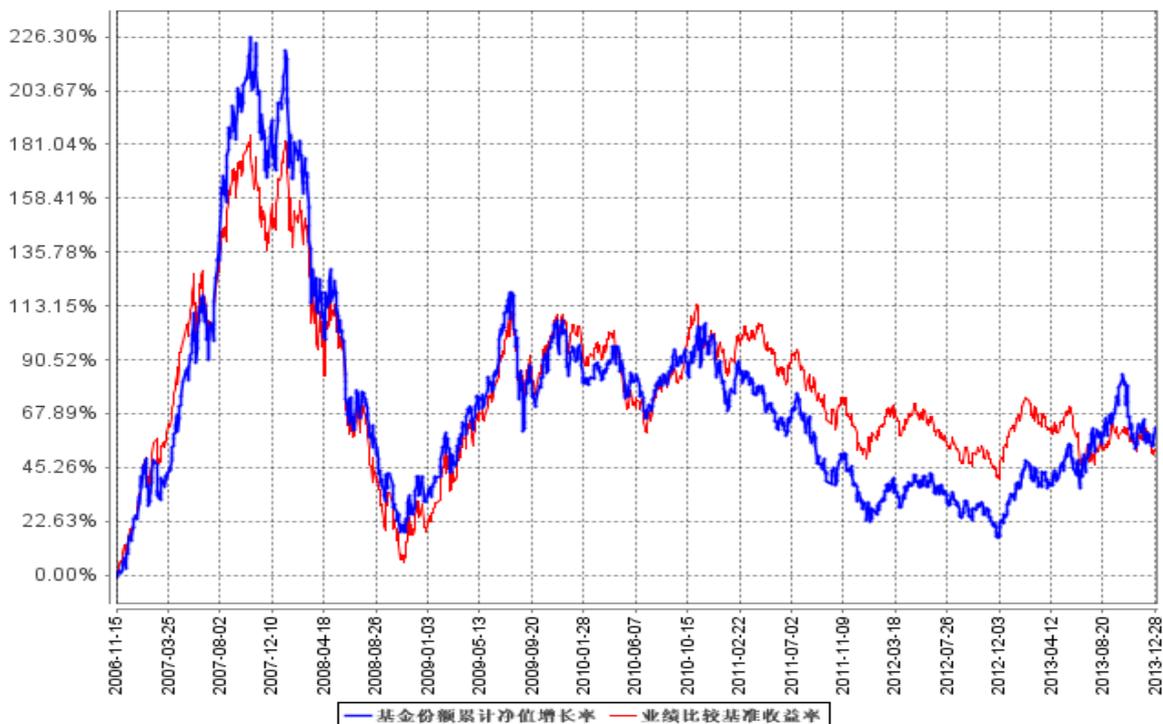
3.2 基金净值表现

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	-9.22%	1.62%	-3.10%	0.90%	-6.12%	0.72%
过去六个月	14.89%	1.63%	3.88%	1.03%	11.01%	0.60%
过去一年	21.36%	1.54%	-4.98%	1.10%	26.34%	0.44%
过去三年	-13.79%	1.31%	-21.24%	1.06%	7.45%	0.25%
过去五年	24.15%	1.42%	29.96%	1.24%	-5.81%	0.18%
自基金合同生效起至今	62.51%	1.68%	53.93%	1.56%	8.58%	0.12%

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

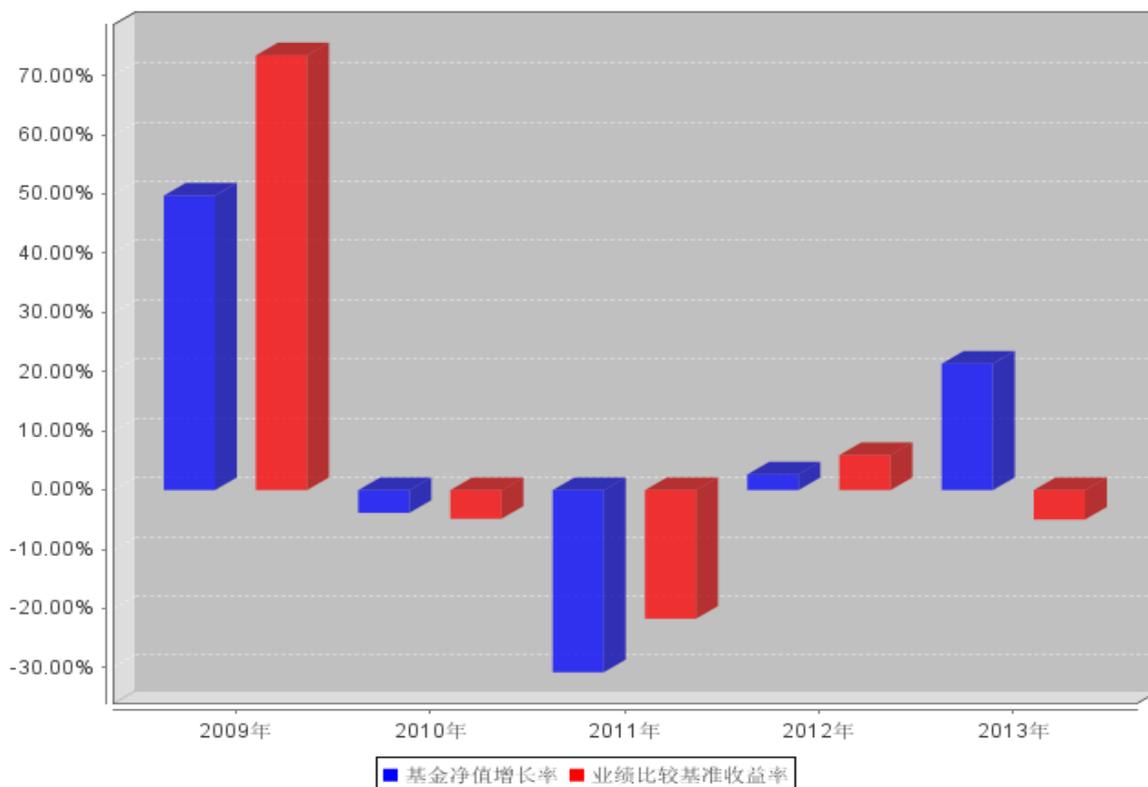
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：上表中基金业绩比较基准项目分段计算，其中 2013 年 6 月 30 日之前（含此日）采用“富时中国 A600 指数收益率×80%+新华巴克莱资本中国全债指数收益率×20%”，2013 年 7 月 1 日起使用新基准即“沪深 300 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%”。

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

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对比图



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
2013	-	-	-	-	-
2012	-	-	-	-	-
2011	0.250	16,661,994.85	37,315,487.69	53,977,482.54	-
合计	0.250	16,661,994.85	37,315,487.69	53,977,482.54	-

§ 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2013年12月31日，公司管理的基金共有二十四只：一只封闭式基金，即融通通乾封闭基金；二十三只开放式基金，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、融通岁岁添利定期开放债券基金、融通丰利四分法（QDII-FOF）基金、融通七天理财债券基金、融通标普中国可转债指数增强基金、融通通泰保本混合基金、融通通泽一年目标触发式混合基金、融通通祥一年目标触发式混合基金、融通通福分级债券基金和融通通源一年目标触发式混合基金。其中，融通债券基金、融通深证 100 指数基金和融通蓝筹成长混合基金同属融通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		
郭恒	本基金的基金经理	2011 年 3 月 24 日	-	17	硕士学位，具有证券从业资格。自 1997 年 9 月进入证券行业，先后任职南方证券投资银行高级经理、君安证券投资银行业务董事、中国服装股份有限公司常务副总经理、华睿投资公司高级研究员，2007 年 6 月至 2010 年 7 月任职华商基金管理有限公司研究部副总监，2010 年 11 月进入融通基金管理有限公司。

注：任职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遵规守信情况的说明

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、《融通动力先锋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

2013 年上证指数全年下跌 6.75%，沪深 300 指数全年下跌 7.65%，中证 500 指数上涨 16.89%，中小板指数上涨 17.54%，创业板指数上涨 82.73%。2013 年市场风格特征明显，以文化传媒、信息服务为主的创业板表现大超市场预期，而金融地产为主沪深 300 和上证指数全年表现为负收益，结构性行情几乎贯穿全年。从市场细分行业结构来看：2013 年涨幅排名前五位的申万行业为：信息服务（78.45%），信息设备（51.66%），电子（42.78%），家用电器（39.33%），医药生物（36.56%）。跌幅前五位的行业为：采掘（-31.18%），有色金属（-29.64%），黑色金属（-17.27%），房地产（-11.94%），建筑建材（-10.82%）。

2013 年中国经济政策面强调调结构和稳增长，进一步进行市场化改革。特别是利率市场化，央行货币政策上坚定推进利率市场化，金融机构去杠杆；此举推升了短期市场利率。十一月份十八届三中全会对中国中长期发展和改革作了全面论述并勾画出宏伟蓝图，增强了境内外投资者对中国未来经济增长的信心。中国经济面临主要问题是高房价、人口老龄化、生产要素市场化不足、政府对经济微观活动管控过度等等。本基金报告期内在投资策略上高度关注中国经济基本面的变化，坚持价值投资理念。基金组合配置上主要以成长股为主，重点配置行业信息服务与设备、医药生物、大众消费、高端装备和环保等。

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 21.36%，同期业绩比较基准收益率为-4.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2014 年，本基金认为中国经济基本面与 2013 年差异不大，仍然还是房地产调控，去

过剩产能，金融去杠杆，促进转型升级。2014 年政府将贯彻落实十八届三中全会精神，进一步深化改革建立和谐社会，转变地方政府职能。改变原来片面追求 GDP 增速，重视民生需求，建立完善社保医疗体系，改善居住环境等。地方政府职能转变也将改变中国经济发展模式和增速，地方政府债务短期会成为隐忧，金融去杠杆可能带来的经济下滑和流动性紧缩风险；与宏观经济增速相关性强的传统周期行业会面临更大的压力，相对而言服务业会进入黄金发展时期。值得重视的是移动互联网在改变人类生产和生活，对各行各业的渗透，改变原有的商业模式和提高效率。从股票市场投资来看，2014 年中国经济转型升级力度会大大强于前几年，传统的经济增长模式将发生彻底转变，服务业发展的黄金时期。本基金将高度重视服务业带来的投资机会，特别是与移动互联网相关的投资机会。与民生相关的大众消费投资机会，外需改善带来的出口型企业投资机会，关注部分传统行业去产能后带来基本面好转的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照《融通基金管理有限公司证券投资基金估值业务原则和程序》进行，公司设立由研究部、风险管理部、登记清算部、固定收益部、国际业务部和监察稽核部共同组成的估值委员会，通过参考行业协会估值意见、参考独立第三方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历，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

截至报告期末，本基金每份基金份额可供分配利润-0.1632 元，依据合同约定，暂不进行利润分配。

§ 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

本报告期内，本基金托管人在对融通动力先锋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

本报告期内，融通动力先锋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动力先锋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，融通动力先锋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动力先锋股票型证券投资基金2013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 2013 年年度财务会计报告已经审计，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告(普华永道中天审字(2014)第 21285 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：融通动力先锋股票型证券投资基金

报告截止日：2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	80,197,375.67	182,630,868.98
结算备付金	16,310,509.28	3,029,907.65
存出保证金	2,250,541.10	1,750,000.00
交易性金融资产	2,115,968,418.98	1,634,811,839.96
其中：股票投资	2,014,293,309.58	1,532,558,430.36
基金投资	-	-

债券投资	101,675,109.40	102,253,409.60
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	49,958,224.98	-
应收证券清算款	-	10,917,483.80
应收利息	914,555.42	592,565.52
应收股利	-	-
应收申购款	126,222.24	134,375.15
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,265,725,847.67	1,833,867,041.06
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2013年12月31日	2012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	66,771,282.62	74,095,648.94
应付赎回款	2,683,130.04	1,009,257.42
应付管理人报酬	2,870,659.12	2,068,305.19
应付托管费	478,443.20	344,717.53
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	8,000,014.30	2,632,359.22
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,204,785.22	1,354,957.17
负债合计	82,008,314.50	81,505,245.47
所有者权益:		
实收基金	1,912,960,238.06	1,861,322,722.64
未分配利润	270,757,295.11	-108,960,927.05
所有者权益合计	2,183,717,533.17	1,752,361,795.59
负债和所有者权益总计	2,265,725,847.67	1,833,867,041.06

注:报告截止日 2013 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.142 元,基金份额总额 1,912,960,238.06 份。

7.2 利润表

会计主体: 融通动力先锋股票型证券投资基金

本报告期: 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
一、收入	448,186,650.65	96,181,749.60
1. 利息收入	5,208,172.08	5,064,361.53
其中：存款利息收入	1,615,957.69	1,611,010.05
债券利息收入	3,335,448.44	3,368,897.95
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	256,765.95	84,453.53
其他利息收入	-	-
2. 投资收益	366,557,431.85	-159,306,129.90
其中：股票投资收益	354,873,655.71	-177,124,965.52
基金投资收益	-	-
债券投资收益	375,972.39	14,500.00
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	11,307,803.75	17,804,335.62
3. 公允价值变动收益	76,069,349.47	250,347,015.29
4. 汇兑收益	-	-
5. 其他收入	351,697.25	76,502.68
减：二、费用	69,140,824.73	48,840,372.04
1. 管理人报酬	30,254,773.94	26,683,791.86
2. 托管费	5,042,462.28	4,447,298.65
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	33,419,014.55	17,288,799.40
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	424,573.96	420,482.13
三、利润总额	379,045,825.92	47,341,377.56
减：所得税费用	-	-
四、净利润	379,045,825.92	47,341,377.56

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通动力先锋股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,861,322,722.64	-108,960,927.05	1,752,361,795.59

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	379,045,825.92	379,045,825.92
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	51,637,515.42	672,396.24	52,309,911.66
其中：1. 基金申购款	434,514,339.25	36,532,149.96	471,046,489.21
2. 基金赎回款	-382,876,823.83	-35,859,753.72	-418,736,577.55
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,912,960,238.06	270,757,295.11	2,183,717,533.17
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,984,058,268.32	-164,663,248.13	1,819,395,020.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	47,341,377.56	47,341,377.56
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-122,735,545.68	8,360,943.52	-114,374,602.16
其中：1. 基金申购款	24,543,766.97	-1,483,151.04	23,060,615.93
2. 基金赎回款	-147,279,312.65	9,844,094.56	-137,435,218.09
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,861,322,722.64	-108,960,927.05	1,752,361,795.59

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：

奚星华

基金管理人负责人

朱建华

主管会计工作负责人

刘美丽

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须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
深圳市融通资本财富管理有限公司	基金管理人的子公司
融通国际资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
新时代证券	1,533,367,261.47	6.93%	1,503,671,243.06	13.23%

7.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
新时代证券	1,395,976.91	7.04%	1,141,249.26	14.27%
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
新时代证券	1,296,479.96	13.21%	231,094.22	8.78%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。权证交易不计佣金。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	30,254,773.94	26,683,791.86
其中：支付销售机构的客户维护费	5,172,492.91	5,027,115.72

注：1、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。

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。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	5,042,462.28	4,447,298.65

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。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期内及上年度末，基金管理人主要股东及其控制的机构均未持有本基金份额。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 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	80,197,375.67	1,332,309.10	182,630,868.98	1,530,580.91

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。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金本报告期及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、本基金本报告期及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）在承销期内承销的证券。

7.4.4.7 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（2013 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

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	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600633	浙报传媒	2013 年 4 月 24 日	2014 年 4 月 22 日	非公开发行 流通受限	13.90	25.41	1,720,000	23,908,000.00	43,705,200.00	-
002106	莱宝高科	2013 年 3 月 18 日	2014 年 3 月 19 日	非公开发行 流通受限	16.52	11.55	1,000,000	16,520,000.00	11,550,000.00	-

注：基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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	2,014,293,309.58	88.90
	其中：股票	2,014,293,309.58	88.90
2	固定收益投资	101,675,109.40	4.49
	其中：债券	101,675,109.40	4.49
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	49,958,224.98	2.20
	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	96,507,884.95	4.26
6	其他各项资产	3,291,318.76	0.15
7	合计	2,265,725,847.67	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	157,000,183.32	7.19
C	制造业	1,239,743,169.35	56.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	63,738,161.20	2.92
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	383,241,263.79	17.55
J	金融业	-	-
K	房地产业	4,839,777.36	0.22
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	72,436,462.26	3.32
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	93,294,292.30	4.27
S	综合	-	-
	合计	2,014,293,309.58	92.24

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	600527	江南高纤	18,345,856	128,054,074.88	5.86
2	600570	恒生电子	4,574,564	95,425,405.04	4.37
3	600587	新华医疗	1,255,162	87,748,375.42	4.02
4	300145	南方泵业	2,304,285	86,756,330.25	3.97
5	002567	唐人神	9,168,892	86,462,651.56	3.96
6	000661	长春高新	754,343	81,997,084.10	3.75
7	002683	宏大爆破	2,608,700	81,600,136.00	3.74
8	300300	汉鼎股份	4,123,522	80,656,090.32	3.69
9	300164	通源石油	4,566,932	75,400,047.32	3.45
10	002501	利源精制	5,274,257	73,892,340.57	3.38

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	600637	百视通	202,628,630.13	11.56
2	300133	华策影视	170,393,791.41	9.72
3	600804	鹏博士	156,820,695.22	8.95
4	300059	东方财富	150,584,219.30	8.59
5	601299	中国北车	144,054,706.49	8.22
6	600837	海通证券	143,606,399.99	8.20
7	300104	乐视网	131,102,060.29	7.48
8	603000	人民网	124,470,345.58	7.10
9	000002	万科A	123,763,305.15	7.06
10	300164	通源石油	117,277,316.74	6.69

11	300055	万邦达	113,594,395.02	6.48
12	600527	江南高纤	112,822,204.54	6.44
13	601318	中国平安	109,619,078.54	6.26
14	600525	长园集团	109,473,343.27	6.25
15	300079	数码视讯	108,313,734.42	6.18
16	600316	洪都航空	107,573,485.97	6.14
17	002482	广田股份	105,544,311.61	6.02
18	002368	太极股份	104,293,644.62	5.95
19	000661	长春高新	103,636,010.31	5.91
20	600108	亚盛集团	100,394,901.11	5.73
21	300300	汉鼎股份	97,636,789.14	5.57
22	600535	天士力	96,603,490.09	5.51
23	002005	德豪润达	89,060,890.21	5.08
24	002241	歌尔声学	88,734,875.69	5.06
25	601933	永辉超市	88,417,930.64	5.05
26	002567	唐人神	85,792,810.49	4.90
27	002683	宏大爆破	79,640,326.89	4.54
28	600887	伊利股份	78,484,183.24	4.48
29	600594	益佰制药	78,300,089.79	4.47
30	000069	华侨城A	78,216,202.05	4.46
31	600315	上海家化	76,699,571.46	4.38
32	600383	金地集团	76,575,478.20	4.37
33	600267	海正药业	75,373,711.67	4.30
34	600570	恒生电子	74,913,996.31	4.28
35	002501	利源精制	71,672,807.02	4.09
36	000012	南玻A	71,488,952.91	4.08
37	600495	晋西车轴	70,939,573.07	4.05
38	000997	新大陆	70,310,699.28	4.01
39	600109	国金证券	70,200,629.03	4.01
40	300145	南方泵业	69,511,140.05	3.97
41	000625	长安汽车	68,767,965.81	3.92
42	601766	中国南车	68,678,183.94	3.92
43	600118	中国卫星	64,521,479.00	3.68
44	600406	国电南瑞	64,402,235.50	3.68
45	600587	新华医疗	63,955,800.16	3.65
46	300024	机器人	63,910,691.80	3.65

47	002646	青青稞酒	63,816,227.90	3.64
48	600585	海螺水泥	62,791,398.26	3.58
49	002148	北纬通信	62,772,530.43	3.58
50	300025	华星创业	62,405,850.34	3.56
51	002415	海康威视	61,744,772.28	3.52
52	601098	中南传媒	61,536,556.45	3.51
53	002230	科大讯飞	61,523,710.27	3.51
54	002638	勤上光电	61,407,097.17	3.50
55	000938	紫光股份	61,244,184.90	3.49
56	601555	东吴证券	60,604,111.10	3.46
57	300070	碧水源	60,383,149.01	3.45
58	300301	长方照明	59,566,494.70	3.40
59	300045	华力创通	58,771,334.38	3.35
60	600597	光明乳业	57,234,838.66	3.27
61	002285	世联地产	56,078,964.13	3.20
62	002255	海陆重工	56,078,094.55	3.20
63	300017	网宿科技	55,474,192.54	3.17
64	601166	兴业银行	54,937,450.80	3.14
65	600458	时代新材	54,861,268.64	3.13
66	600067	冠城大通	53,843,133.22	3.07
67	002376	新北洋	53,695,137.13	3.06
68	601377	兴业证券	53,163,650.43	3.03
69	002292	奥飞动漫	52,904,403.26	3.02
70	600801	华新水泥	52,727,572.93	3.01
71	002013	中航精机	52,414,980.02	2.99
72	002648	卫星石化	51,990,971.43	2.97
73	000400	许继电气	51,344,377.00	2.93
74	002465	海格通信	50,627,043.45	2.89
75	000043	中航地产	49,729,211.54	2.84
76	600536	中国软件	49,692,122.58	2.84
77	300168	万达信息	49,213,562.67	2.81
78	300251	光线传媒	49,026,943.96	2.80
79	300274	阳光电源	48,955,031.01	2.79
80	000050	深天马A	48,245,361.63	2.75
81	600859	王府井	48,118,644.22	2.75
82	600048	保利地产	47,903,608.94	2.73

83	300351	永贵电器	47,613,259.91	2.72
84	000651	格力电器	47,605,144.41	2.72
85	300014	亿纬锂能	47,604,171.97	2.72
86	002429	兆驰股份	47,314,797.42	2.70
87	600169	太原重工	47,301,747.30	2.70
88	600016	民生银行	47,299,113.43	2.70
89	601788	光大证券	47,298,321.89	2.70
90	600261	阳光照明	46,601,264.03	2.66
91	600066	宇通客车	45,947,258.38	2.62
92	002106	莱宝高科	45,819,754.76	2.61
93	600125	铁龙物流	45,689,784.49	2.61
94	002439	启明星辰	45,549,999.37	2.60
95	600372	中航电子	45,388,831.97	2.59
96	601633	长城汽车	45,374,585.12	2.59
97	002223	鱼跃医疗	45,226,811.04	2.58
98	002153	石基信息	45,181,952.24	2.58
99	600369	西南证券	44,144,890.51	2.52
100	600196	复星医药	44,092,923.25	2.52
101	000024	招商地产	43,678,117.51	2.49
102	600089	特变电工	42,994,319.12	2.45
103	000800	一汽轿车	42,784,687.78	2.44
104	600256	广汇能源	42,438,624.92	2.42
105	300315	掌趣科技	41,878,731.90	2.39
106	002236	大华股份	41,748,351.86	2.38
107	002348	高乐股份	41,734,228.74	2.38
108	601311	骆驼股份	41,705,293.68	2.38
109	300003	乐普医疗	41,483,878.16	2.37
110	000816	江淮动力	40,690,357.42	2.32
111	000729	燕京啤酒	40,583,354.03	2.32
112	600600	青岛啤酒	39,994,974.18	2.28
113	002405	四维图新	39,647,850.21	2.26
114	002456	欧菲光	39,612,465.47	2.26
115	601117	中国化学	38,118,358.93	2.18
116	600702	沱牌舍得	37,903,160.21	2.16
117	300015	爱尔眼科	37,760,863.64	2.15
118	002008	大族激光	37,362,302.43	2.13

119	300128	锦富新材	36,807,983.48	2.10
120	000100	TCL 集团	36,392,060.00	2.08
121	000001	平安银行	36,134,860.07	2.06
122	600332	白云山	35,612,854.51	2.03
123	600085	同仁堂	35,411,493.43	2.02
124	002038	双鹭药业	35,309,992.71	2.01

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	600804	鹏博士	180,843,400.46	10.32
2	600837	海通证券	178,832,094.00	10.21
3	600637	百视通	160,790,153.48	9.18
4	601318	中国平安	158,925,275.21	9.07
5	300059	东方财富	154,904,470.63	8.84
6	000002	万科A	154,215,345.65	8.80
7	603000	人民网	153,773,651.84	8.78
8	000069	华侨城A	129,326,911.12	7.38
9	600527	江南高纤	119,735,377.55	6.83
10	300133	华策影视	118,789,431.03	6.78
11	601299	中国北车	116,900,388.10	6.67
12	600108	亚盛集团	111,993,217.79	6.39
13	300079	数码视讯	108,384,425.77	6.19
14	600316	洪都航空	107,377,212.58	6.13
15	600535	天士力	106,974,221.65	6.10
16	002241	歌尔声学	103,825,352.89	5.92
17	600495	晋西车轴	98,900,979.99	5.64
18	002482	广田股份	97,204,423.66	5.55
19	300168	万达信息	94,160,325.26	5.37
20	600016	民生银行	93,899,391.91	5.36
21	600383	金地集团	90,608,788.70	5.17
22	600801	华新水泥	89,273,856.47	5.09
23	601933	永辉超市	89,226,176.93	5.09
24	600887	伊利股份	87,820,448.21	5.01
25	002292	奥飞动漫	86,032,799.70	4.91
26	601166	兴业银行	83,193,412.92	4.75

27	300104	乐视网	78,912,868.21	4.50
28	002230	科大讯飞	77,737,677.19	4.44
29	600030	中信证券	76,859,113.04	4.39
30	002368	太极股份	75,143,385.71	4.29
31	600048	保利地产	75,020,559.09	4.28
32	000625	长安汽车	74,782,591.25	4.27
33	600085	同仁堂	74,380,853.05	4.24
34	600315	上海家化	73,682,819.75	4.20
35	601633	长城汽车	73,345,491.94	4.19
36	000661	长春高新	72,156,705.80	4.12
37	600109	国金证券	71,958,305.28	4.11
38	000430	张家界	69,856,824.53	3.99
39	600267	海正药业	69,701,833.86	3.98
40	002005	德豪润达	69,139,162.04	3.95
41	600138	中青旅	69,116,091.73	3.94
42	600585	海螺水泥	68,453,750.86	3.91
43	002148	北纬通信	68,326,734.03	3.90
44	300024	机器人	67,717,986.47	3.86
45	000997	新大陆	67,669,832.01	3.86
46	601098	中南传媒	65,806,970.34	3.76
47	600517	置信电气	64,464,897.56	3.68
48	600458	时代新材	64,014,746.11	3.65
49	000789	江西水泥	62,185,907.56	3.55
50	300025	华星创业	61,627,520.99	3.52
51	000012	南玻A	61,482,641.51	3.51
52	002646	青青稞酒	61,275,199.73	3.50
53	601377	兴业证券	61,215,834.86	3.49
54	300017	网宿科技	61,093,975.52	3.49
55	601555	东吴证券	60,766,090.82	3.47
56	002415	海康威视	59,875,105.83	3.42
57	000938	紫光股份	59,753,792.48	3.41
58	002376	新北洋	59,502,742.77	3.40
59	002638	勤上光电	57,673,668.36	3.29
60	300315	掌趣科技	57,424,202.88	3.28
61	600256	广汇能源	57,003,441.27	3.25
62	300301	长方照明	55,328,948.62	3.16
63	600406	国电南瑞	55,203,972.19	3.15
64	600525	长园集团	54,544,251.30	3.11

65	002429	兆驰股份	54,091,432.42	3.09
66	600066	宇通客车	53,470,036.23	3.05
67	002255	海陆重工	51,008,279.97	2.91
68	600067	冠城大通	50,120,753.77	2.86
69	300055	万邦达	50,067,823.78	2.86
70	600750	江中药业	50,030,461.51	2.86
71	300014	亿纬锂能	49,314,275.68	2.81
72	002439	启明星辰	49,141,917.66	2.80
73	002285	世联地产	49,055,965.79	2.80
74	300088	长信科技	48,868,179.80	2.79
75	600261	阳光照明	48,827,869.14	2.79
76	000043	中航地产	48,817,277.38	2.79
77	600536	中国软件	47,989,787.12	2.74
78	000690	宝新能源	47,886,068.56	2.73
79	002648	卫星石化	47,659,043.76	2.72
80	300251	光线传媒	47,530,412.65	2.71
81	000400	许继电气	46,979,549.97	2.68
82	300274	阳光电源	46,962,833.54	2.68
83	000651	格力电器	45,635,464.27	2.60
84	600169	太原重工	45,472,178.00	2.59
85	000800	一汽轿车	45,074,184.16	2.57
86	002153	石基信息	44,961,546.87	2.57
87	000050	深天马A	44,657,375.58	2.55
88	600372	中航电子	43,882,273.87	2.50
89	600221	海南航空	43,809,666.96	2.50
90	002106	莱宝高科	42,948,517.75	2.45
91	300164	通源石油	42,738,189.06	2.44
92	600125	铁龙物流	42,287,748.05	2.41
93	601788	光大证券	42,266,136.56	2.41
94	600859	王府井	42,170,411.53	2.41
95	002223	鱼跃医疗	42,146,207.58	2.41
96	002236	大华股份	42,137,620.88	2.40
97	600196	复星医药	42,083,205.56	2.40
98	600369	西南证券	41,934,253.38	2.39
99	600600	青岛啤酒	41,173,959.19	2.35
100	300070	碧水源	40,834,050.66	2.33
101	002348	高乐股份	40,829,246.33	2.33
102	000024	招商地产	40,787,606.12	2.33

103	002038	双鹭药业	39,925,203.61	2.28
104	002405	四维图新	39,583,040.62	2.26
105	002477	雏鹰农牧	39,291,967.89	2.24
106	601311	骆驼股份	39,227,356.43	2.24
107	600594	益佰制药	39,015,140.14	2.23
108	600089	特变电工	38,920,448.39	2.22
109	002456	欧菲光	38,811,100.18	2.21
110	000729	燕京啤酒	38,468,254.15	2.20
111	601012	隆基股份	37,997,784.54	2.17
112	000816	江淮动力	37,652,484.01	2.15
113	002273	水晶光电	37,176,653.26	2.12
114	000895	双汇发展	37,053,083.45	2.11
115	000100	TCL 集团	36,599,015.10	2.09
116	600578	京能电力	36,495,049.88	2.08
117	601117	中国化学	36,091,635.07	2.06
118	600332	白云山	35,825,920.48	2.04
119	300003	乐普医疗	35,813,351.72	2.04
120	600805	悦达投资	35,807,840.01	2.04
121	600597	光明乳业	35,373,183.43	2.02

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	11,103,430,342.30
卖出股票收入（成交）总额	11,052,757,558.88

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”均按成交单价乘以成交数量填列，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	99,300,000.00	4.55
	其中：政策性金融债	99,300,000.00	4.55
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,375,109.40	0.11

8	其他	-	-
9	合计	101,675,109.40	4.66

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	130243	13 国开 43	1,000,000	99,300,000.00	4.55
2	110022	同仁转债	19,010	2,375,109.40	0.11

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内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。

1、长春高新于 2013 年 5 月 2 日公告，其于 2013 年 4 月 8 日收到的吉林证监局下发的吉证监决【2013】4 号《关于对长春高新技术产业（集团）股份有限公司采取责令改正措施的决定》并于 2013 年 4 月 12 日对该《责令改正决定书》的内容进行了公告，整改结果为由公司实际控制人长春高新技术产业发展总公司下属企业——长春高新光电发展有限公司代偿关联方长春医药（集团）有限责任公司的上述欠款，金额合计 2,974.62 万元。

公司已针对上述欠款计提坏账准备金共计 2,974.62 万元, 经与本公司聘请的会计师事务所确认, 本次收回欠款将在 2013 年第二季度冲抵坏账准备并增加本期收益 2,974.62 万元。对公司生产经营没有重大影响。

2、宏大爆破股份有限公司于 2013 年 1 月 25 日公告: 近日, 韶关市安全生产监督管理局对公司下属子公司——广东明华机械有限公司韶关分公司、罗定分公司分别出具了《行政处罚决定书》, ((韶) 安监管罚【2012】14 号、(韶) 安监管罚【2012】15 号), 《行政处罚决定书》相关内容如下:

广东明华机械有限公司韶关分公司对车辆管理混乱, 转让租赁手续不清, 对京港澳高速公路韶关曲江路段宝林山隧道“8.22”事故发生负有责任, 依据有关规定, 决定给予处以人民币 10 万元罚款的行政处罚。

广东明华机械有限公司罗定分公司在运输危险货物时没有遵守有关法律法规对危险货物运输的有关规定, 使用未取得危险货物运输许可证的车辆运输危险货物, 对京港澳高速公路韶关曲江路段宝林山隧道“8.22”事故发生负有责任, 依据有关规定, 决定给予处以人民币 10 万元罚款的行政处罚。

该事件对上市公司不构成重大影响, 目前, 广东明华机械有限公司的危险品运输工作正常开展。

3、通源石油于 2013 年 12 月 10 日公告, 西安通源石油科技股份有限公司(以下简称“本公司或公司”) 2013 年 12 月 10 日收到中国证券监督管理委员会陕西监管局(以下简称“陕西证监局”) 下发的《行政监管措施决定书》(陕证监措施字【2013】6 号) - 《关于对西安通源石油科技股份有限公司采取责令改正措施的决定》, 陕西证监局发现公司存在以下问题:

2013 年 6 月 8 日, 公司与陕西蓝海风投资管理有限公司签订股权转让协议, 以 7,408.75 万元的价格转让子公司西安通源万信商务信息咨询有限公司 100% 股权。该交易产生利润 1,008.75 万元, 占 2012 年度公司净利润 16.88%, 已触及《公司章程》第一百二十五条规定的董事会决策权限, 但未提交董事会审议, 且在 2013 年 8 月 23 日发布的 2013 年半年度报告关于该事项的表述中称“依据《公司章程》等相关规定, 该处置属总裁权限内”, 与《公司章程》规定不符, 信息披露不真实。

上述行为违反了《证券法》第六十三条、《上市公司信息披露管理办法》(证监会令第 40 号) 第二条的规定。西安通源石油科技股份有限公司根据相关信息披露法律法规及中国证券监督管理委员会陕西监管局下发的《行政监管措施决定书》(陕证监措施字【2013】6 号) - 《关于对西安通源石油科技股份有限公司采取责令改正措施的决定》的整改要求, 已于 2013 年 12 月 20 日对以

上定期报告内容做出更正并发布公告。

本次事件涉及的金额对公司经营及基本面影响不大，风险可控，本基金及时跟踪事件进展，注意投资风险。

4、报告期内，除上述证券外，本基金投资的前十名证券中其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.11.2 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

8.11.3 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	2,250,541.10
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	914,555.42
5	应收申购款	126,222.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,291,318.76

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110022	同仁转债	2,375,109.40	0.11

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§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
96,886	19,744.44	293,936,847.80	15.37%	1,619,023,390.26	84.63%

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
----	------------	----------

基金管理人所有从业人员持有本基金	210,728.19	0.0110%
------------------	------------	---------

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：0；

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

单位：份

基金合同生效日（2006年11月15日）基金份额总额	3,364,280,448.23
本报告期期初基金份额总额	1,861,322,722.64
本报告期基金总申购份额	434,514,339.25
减：本报告期基金总赎回份额	382,876,823.83
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,912,960,238.06

§ 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 基金管理人的重大变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

11.2.2 基金托管人的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。本年度应支付的审计费为人民币 100,000.00 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，本基金的基金管理人、托管人的托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
国开证券	1	5,285,642,908.62	23.90%	4,677,269.66	23.58%	-
光大证券	1	3,758,251,058.81	16.99%	3,325,682.82	16.77%	-
申银万国	1	1,768,440,794.65	8.00%	1,609,986.63	8.12%	-
新时代证券	1	1,533,367,261.47	6.93%	1,395,976.91	7.04%	-
华鑫证券	1	1,487,828,382.38	6.73%	1,354,516.06	6.83%	-
广州证券	2	1,485,341,049.80	6.72%	1,352,255.83	6.82%	-
中信建投	1	1,372,512,828.99	6.21%	1,249,532.40	6.30%	-
中信证券	1	1,266,033,501.67	5.72%	1,120,314.54	5.65%	-
渤海证券	2	901,953,937.58	4.08%	798,896.22	4.03%	-
中山证券	2	873,747,117.35	3.95%	795,458.80	4.01%	-
安信证券	1	758,942,002.86	3.43%	690,940.84	3.48%	-
国泰君安	1	633,023,918.41	2.86%	560,163.55	2.82%	-
恒泰证券	2	622,300,684.82	2.81%	566,543.54	2.86%	本期终止交易单元 1 个
中航证券	1	268,388,383.11	1.21%	244,338.44	1.23%	-
平安证券	1	99,986,070.66	0.45%	91,027.06	0.46%	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	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) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

(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

在上述租用的券商交易单元中, 华鑫证券、广州证券和中航证券交易共 4 个交易单元为本基金本期新增的交易单元。本期终止恒泰证券交易单元 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
国开证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	150,000,000.00	60.00%	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	6,137,519.10	100.00%	100,000,000.00	40.00%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-

长江证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

融通基金管理有限公司
二〇一四年三月二十七日