

融通内需驱动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 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 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	745, 583, 356. 24 份

### 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	赵会军
	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

### 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	<a href="http://www.rtfund.com">http://www.rtfund.com</a>
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	59,246,256.32	-122,316,197.69	-98,134,113.31
本期利润	39,465,455.64	39,763,384.78	-255,368,397.85
加权平均基金份额本期利润	0.0540	0.0644	-0.4015
本期基金份额净值增长率	10.39%	10.67%	-40.20%
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	-0.2557	-0.3264	-0.3906
期末基金资产净值	554,966,286.21	408,276,533.50	380,052,058.67
期末基金份额净值	0.744	0.674	0.609

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）。

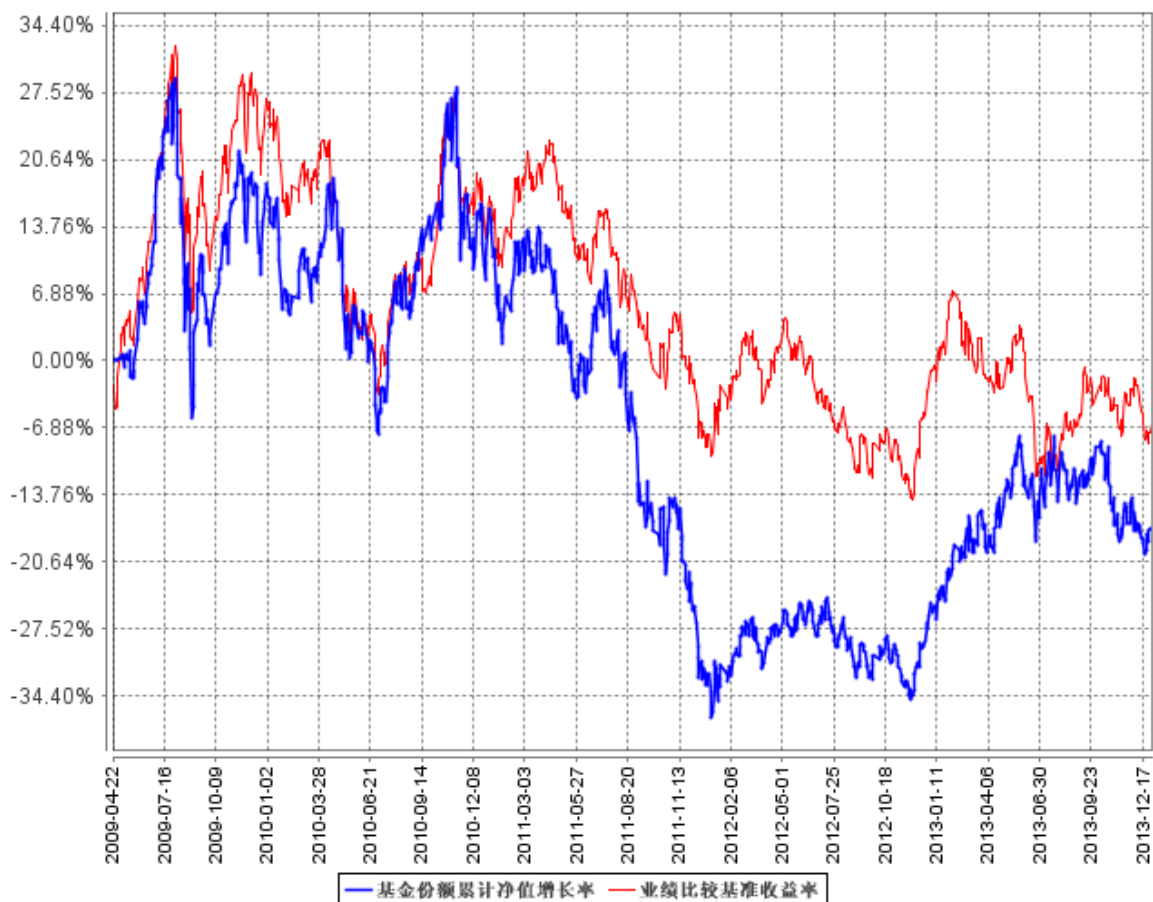
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	-9.05%	1.25%	-2.81%	0.90%	-6.24%	0.35%
过去六个月	-1.33%	1.32%	4.67%	1.04%	-6.00%	0.28%
过去一年	10.39%	1.35%	-5.49%	1.12%	15.88%	0.23%
过去三年	-26.94%	1.37%	-18.68%	1.06%	-8.26%	0.31%
自基金合同生效起至今	-17.15%	1.48%	-6.43%	1.20%	-10.72%	0.28%

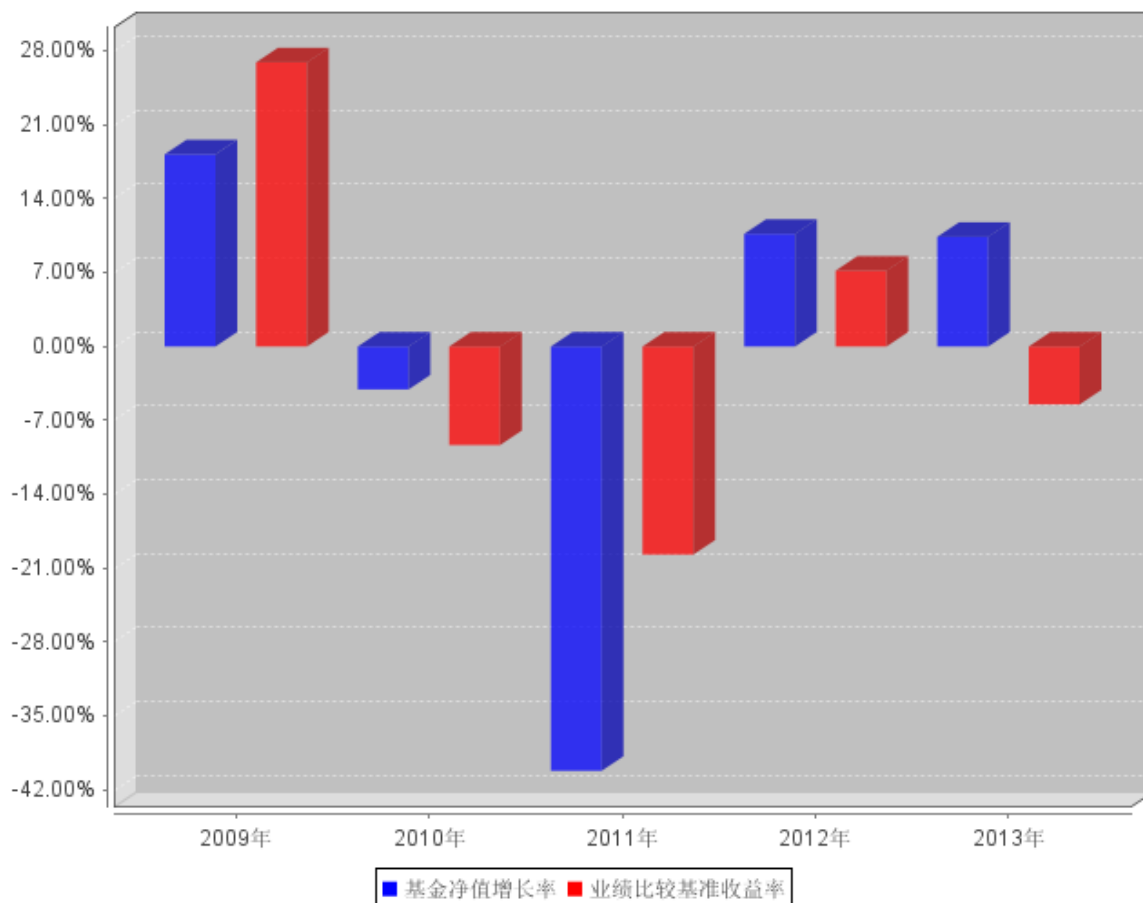
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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
2013	-	-	-	-	
2012	-	-	-	-	
2011	0.200	5,802,746.84	7,468,274.37	13,271,021.21	
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、融通通泽一年目标触发式混合及融通通源一年目标触发式混合的基金经理	2012 年 1 月 5 日	-	6	硕士研究生，具有基金从业资格。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。

注：任职日期指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工作的时间为计算标准。

#### 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

如果说 2010 年是中国股市结构转型的预言,那么 2013 年就是中国股市结构转型的高潮。2013 年全年在沪深 300 指数下跌 7.65%的背景下,创业板指数上涨 82.73%,中小板指上涨 17.54%,涨幅超过一倍的股票多达数百只。

本基金在 2013 年 2 月份时意识到全年经济可能偏平稳,不会有大幅波动,同时房地产后周期影响将逐步体现,在此判断下,本基金大幅调仓至中小盘成长性股票,行业配置集中在环保、医药、电子。上半年取得了较好的效果。

但 7、8 月份随着中报的陆续披露,本基金发现很多上半年表现较好的成长股中报低于预期,估值与增长的匹配度在下降,同时,由于非标资产的存在,银行间资金面日趋紧张。因而,本基金在 7、8 月份开始平衡组合,大幅降低了成长股的比例,而增加了相对低位的银行、地产股的配置。事实上,由于经济的地位均衡,周期股的向上弹性非常有限,以地产股为代表的传统产业甚至不断创出新低。而在 IPO 停发,存量资产大搬家的情况下,很多依靠外延扩张的行业依然获得很高的收益率,例如,传媒、计算机、医疗服务等。由于这些资产配置的缺失,本基金在 8 月份后大幅跑输同类基金,给投资者造成了不少的损失。

### 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 10.39%,同期业绩比较基准收益率为-5.49%。

## 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,中国经济将更为复杂,风险点在于,房地产及信托的风险一天不爆,市场始终无法获得出清后的新生,而如果真出现风险释放,那对短期经济的影响而目前较高估值的成长股来说又将产生巨大影响,这一纠结状况不会轻松得到化解。

向好的因素是,随着国家对过剩产能的清理,以及 08 年后,长达 5 年时间的行业自律,我们观察到部分行业的产能供需情况正逐步缓解,企业自发的资本性支出在恢复。同时,在国家改革浪潮下,部分行业随着激励机制、经营效率和外部环境支持下,存在较大的市值提升空间。

在上述因素的共同影响下,本基金认为今年大盘的波动空间仍然不大,但在资金面偏紧而 IPO 重新开闸后,成长价值之间巨大的估值差难以继续扩张,这就需要反复超预期的业绩来维系或缩窄估值差。因此,今年在保持大类资产相对均衡的基础上,寻找低估值行业产能出清后的高弹性以及目前较高估值的个股中寻找外延扩张加速和业绩超预期的股票可能是今年公募基金获得超额收益的关键。

## 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。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 2013 年 12 月 31 日，本基金每基金份额可供分配利润为-0.2557 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

本报告期内，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

本报告期内，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 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 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(2014)第 21280 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：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
<b>资产：</b>		
银行存款	54,817,777.73	48,555,557.69
结算备付金	7,541,733.94	2,131,588.94

存出保证金	874,385.14	3,443,250.59
交易性金融资产	479,275,847.02	336,311,437.12
其中：股票投资	449,440,847.02	316,339,437.12
基金投资	-	-
债券投资	29,835,000.00	19,972,000.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	19,100,228.65	-
应收证券清算款	19,652,549.89	20,000,425.95
应收利息	710,949.01	197,159.88
应收股利	-	-
应收申购款	50,035.56	81,591.80
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	582,023,506.94	410,721,011.97
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2013年12月31日</b>	<b>2012年12月31日</b>
<b>负 债：</b>		
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	21,765,201.79	-
应付赎回款	405,725.94	250,334.06
应付管理人报酬	708,802.48	484,135.92
应付托管费	118,133.74	80,689.34
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,488,676.04	1,074,006.09
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	570,680.74	555,313.06
负债合计	27,057,220.73	2,444,478.47
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	745,583,356.24	606,105,500.59
未分配利润	-190,617,070.03	-197,828,967.09
所有者权益合计	554,966,286.21	408,276,533.50
负债和所有者权益总计	582,023,506.94	410,721,011.97

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.744 元，基金份额总额 745,583,356.24 份。

## 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：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
<b>一、收入</b>	67,700,245.25	56,470,747.47
1. 利息收入	1,890,841.07	1,203,743.40
其中：存款利息收入	693,035.34	486,635.83
债券利息收入	897,544.80	669,695.10
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	300,260.93	47,412.47
其他利息收入	-	-
2. 投资收益	85,308,491.83	-106,829,734.35
其中：股票投资收益	81,243,460.26	-111,024,738.73
基金投资收益	-	-
债券投资收益	185,680.25	60.00
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	3,879,351.32	4,194,944.38
3. 公允价值变动收益	-19,780,800.68	162,079,582.47
4. 汇兑收益	-	-
5. 其他收入	281,713.03	17,155.95
<b>减：二、费用</b>	28,234,789.61	16,707,362.69
1. 管理人报酬	8,331,997.90	5,887,201.99
2. 托管费	1,388,666.28	981,200.38
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	18,223,022.69	9,470,040.37
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	291,102.74	368,919.95
<b>三、利润总额</b>	39,465,455.64	39,763,384.78
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润</b>	39,465,455.64	39,763,384.78

**7.3 所有者权益（基金净值）变动表**

会计主体：融通内需驱动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）	606,105,500.59	-197,828,967.09	408,276,533.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	39,465,455.64	39,465,455.64

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	139,477,855.65	-32,253,558.58	107,224,297.07
其中：1. 基金申购款	431,814,832.49	-96,836,690.57	334,978,141.92
2. 基金赎回款	-292,336,976.84	64,583,131.99	-227,753,844.85
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）	745,583,356.24	-190,617,070.03	554,966,286.21
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）	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

注：后附 7.4 报表附注为本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：

基金管理公司负责人：奚星华 主管会计工作负责人：朱建华 会计机构负责人：刘美丽

### 7.3.1 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。

### 7.3.2 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。

### 7.3.3 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	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。

### 7.3.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.3.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

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。

### 7.3.4.2 关联方报酬

#### 7.3.4.2.1 基金管理费

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
当期发生的基金应支付的管理费	8,331,997.90	5,887,201.99
其中：支付销售机构的客户维护费	2,197,985.24	1,525,968.12

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。

#### 7.3.4.2.2 基金托管费

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
当期发生的基金应支付的托管费	1,388,666.28	981,200.38

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。

### 7.3.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 7.3.4.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.3.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 7.3.4.4.2 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。

### 7.3.4.5 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		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	
	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	54,817,777.73	559,799.91	48,555,557.69	445,272.03

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。

### 7.3.4.6 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。

### 7.3.4.7 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。

### 7.3.5 期末（2013 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.3.5.1 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（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600633	浙报传媒	2013-4-24	2014-4-22	非公开增发	13.90	25.41	410,000	5,699,000.00	10,418,100.00	-

#### 7.3.5.2 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
601901	方正证券	2013-8-26	重大资产重组	5.91	2014-1-13	6.24	1,400,000	8,296,461.58	8,274,000.00	-

注：本基金截至 2013 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。

#### 7.3.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.3.5.3.1 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。

##### 7.3.5.3.2 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	449,440,847.02	77.22
	其中：股票	449,440,847.02	77.22
2	固定收益投资	29,835,000.00	5.13
	其中：债券	29,835,000.00	5.13

	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	19,100,228.65	3.28
	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	62,359,511.67	10.71
6	其他各项资产	21,287,919.60	3.66
7	合计	582,023,506.94	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	-	-
B	采矿业	5,862,500.00	1.06
C	制造业	302,609,213.60	54.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,533,734.78	5.32
J	金融业	78,761,098.64	14.19
K	房地产业	6,680,000.00	1.20
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	15,576,200.00	2.81
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	10,418,100.00	1.88
S	综合	-	-
	合计	449,440,847.02	80.99

## 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	600587	新华医疗	386,794	27,040,768.54	4.87
2	601318	中国平安	590,000	24,620,700.00	4.44
3	002631	德尔家居	1,319,941	21,779,026.50	3.92
4	000651	格力电器	500,000	16,330,000.00	2.94
5	300017	网宿科技	190,000	16,093,000.00	2.90
6	300070	碧水源	380,000	15,576,200.00	2.81

7	002236	大华股份	380,000	15,534,400.00	2.80
8	600535	天士力	320,000	13,724,800.00	2.47
9	000661	长春高新	124,980	13,585,326.00	2.45
10	601166	兴业银行	1,199,926	12,167,249.64	2.19

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	600585	海螺水泥	101,845,119.05	24.95
2	600837	海通证券	99,103,113.79	24.27
3	600016	民生银行	96,198,416.91	23.56
4	300104	乐视网	70,818,161.57	17.35
5	002415	海康威视	70,685,005.29	17.31
6	300027	华谊兄弟	66,950,826.85	16.40
7	603000	人民网	64,095,779.29	15.70
8	002241	歌尔声学	63,917,088.97	15.66
9	601166	兴业银行	63,634,694.81	15.59
10	000651	格力电器	61,906,161.60	15.16
11	300074	华平股份	61,656,249.72	15.10
12	300058	蓝色光标	60,170,743.10	14.74
13	000002	万科 A	58,986,915.39	14.45
14	000661	长春高新	58,411,519.82	14.31
15	000001	平安银行	58,052,272.24	14.22
16	300017	网宿科技	56,309,470.46	13.79
17	601318	中国平安	55,702,866.44	13.64
18	600518	康美药业	53,454,953.23	13.09
19	600000	浦发银行	53,255,248.47	13.04
20	600535	天士力	51,709,037.52	12.67
21	002450	康得新	50,510,092.38	12.37
22	600030	中信证券	49,535,141.93	12.13
23	000024	招商地产	47,997,842.81	11.76
24	600104	上汽集团	45,848,786.00	11.23
25	000625	长安汽车	45,182,875.34	11.07
26	300157	恒泰艾普	44,776,790.04	10.97
27	002456	欧菲光	44,748,584.59	10.96
28	300070	碧水源	43,563,591.59	10.67
29	600315	上海家化	43,064,313.21	10.55
30	002236	大华股份	42,312,123.75	10.36



31	002230	科大讯飞	41,862,264.35	10.25
32	300026	红日药业	40,690,335.07	9.97
33	601299	中国北车	40,669,577.86	9.96
34	300124	汇川技术	40,110,245.78	9.82
35	002353	杰瑞股份	39,475,224.96	9.67
36	002482	广田股份	39,246,916.75	9.61
37	300024	机器人	39,141,189.14	9.59
38	000049	德赛电池	38,933,682.06	9.54
39	002400	省广股份	38,302,070.31	9.38
40	601766	中国南车	38,081,984.94	9.33
41	300273	和佳股份	37,770,075.98	9.25
42	600887	伊利股份	37,344,204.10	9.15
43	600383	金地集团	37,329,670.29	9.14
44	002271	东方雨虹	37,016,492.06	9.07
45	600703	三安光电	36,850,079.90	9.03
46	600804	鹏博士	36,521,735.85	8.95
47	601633	长城汽车	35,285,813.74	8.64
48	300168	万达信息	35,262,974.33	8.64
49	000538	云南白药	33,247,020.41	8.14
50	300228	富瑞特装	32,955,879.15	8.07
51	002475	立讯精密	32,649,302.73	8.00
52	600587	新华医疗	32,544,149.13	7.97
53	300251	光线传媒	32,478,763.95	7.96
54	002570	贝因美	31,913,161.34	7.82
55	000400	许继电气	31,910,529.35	7.82
56	002221	东华能源	31,525,512.80	7.72
57	600196	复星医药	30,996,292.70	7.59
58	002273	水晶光电	29,839,865.81	7.31
59	600048	保利地产	29,687,598.94	7.27
60	600332	白云山	29,466,089.66	7.22
61	600637	百视通	29,369,541.95	7.19
62	002410	广联达	29,168,596.05	7.14
63	002310	东方园林	28,340,922.32	6.94
64	600519	贵州茅台	27,949,923.37	6.85
65	300146	汤臣倍健	27,862,187.81	6.82
66	600597	光明乳业	27,525,736.42	6.74
67	600999	招商证券	27,319,000.67	6.69
68	600809	山西汾酒	26,764,141.13	6.56
69	002405	四维图新	26,644,518.13	6.53
70	600028	中国石化	26,589,776.34	6.51
71	600406	国电南瑞	26,375,588.05	6.46
72	002573	国电清新	26,121,984.32	6.40

73	300253	卫宁软件	26,059,505.41	6.38
74	600079	人福医药	25,474,805.37	6.24
75	600521	华海药业	25,201,547.21	6.17
76	002635	安洁科技	25,014,940.57	6.13
77	600690	青岛海尔	24,851,271.06	6.09
78	600252	中恒集团	24,096,232.86	5.90
79	600418	江淮汽车	24,028,298.55	5.89
80	601939	建设银行	24,000,624.46	5.88
81	601628	中国人寿	23,659,702.90	5.80
82	600570	恒生电子	23,646,728.22	5.79
83	600036	招商银行	23,492,181.58	5.75
84	002081	金螳螂	23,117,487.26	5.66
85	002146	荣盛发展	22,754,694.21	5.57
86	600835	上海机电	22,615,174.47	5.54
87	600256	广汇能源	22,453,099.48	5.50
88	000050	深天马 A	21,969,130.30	5.38
89	300090	盛运股份	21,923,190.34	5.37
90	000550	江铃汽车	21,738,866.09	5.32
91	600583	海油工程	21,705,737.35	5.32
92	002566	益盛药业	21,515,237.50	5.27
93	000671	阳光城	21,409,815.97	5.24
94	002439	启明星辰	21,376,478.21	5.24
95	600150	中国船舶	20,823,110.31	5.10
96	300347	泰格医药	20,805,907.28	5.10
97	002191	劲嘉股份	20,509,122.88	5.02
98	002631	德尔家居	20,454,458.93	5.01
99	300088	长信科技	20,221,714.73	4.95
100	000915	山大华特	20,148,044.00	4.93
101	002292	奥飞动漫	19,989,954.38	4.90
102	002305	南国置业	19,859,042.27	4.86
103	300147	香雪制药	19,603,331.99	4.80
104	600372	中航电子	19,583,138.47	4.80
105	300274	阳光电源	19,547,346.15	4.79
106	600123	兰花科创	19,399,125.93	4.75
107	300014	亿纬锂能	19,284,497.51	4.72
108	000748	长城信息	19,017,694.81	4.66
109	601336	新华保险	19,009,240.34	4.66
110	002005	德豪润达	18,962,829.70	4.64
111	002024	苏宁云商	18,892,074.89	4.63
112	000063	中兴通讯	18,662,659.65	4.57
113	002038	双鹭药业	18,447,249.04	4.52
114	600089	特变电工	18,294,168.39	4.48

115	300212	易华录	18,234,967.77	4.47
116	002440	闰土股份	18,032,600.29	4.42
117	000540	中天城投	17,958,976.22	4.40
118	300285	国瓷材料	17,892,786.08	4.38
119	300300	汉鼎股份	17,731,152.86	4.34
120	002063	远光软件	17,204,541.26	4.21
121	600801	华新水泥	17,166,630.01	4.20
122	600900	长江电力	16,925,613.59	4.15
123	601877	正泰电器	16,637,157.09	4.07
124	000338	潍柴动力	16,596,969.18	4.07
125	000596	古井贡酒	16,405,379.77	4.02
126	300257	开山股份	16,279,766.51	3.99
127	300182	捷成股份	16,277,285.63	3.99
128	300205	天喻信息	16,265,091.15	3.98
129	300075	数字政通	16,183,733.17	3.96
130	600157	永泰能源	15,458,704.92	3.79
131	300133	华策影视	15,210,795.14	3.73
132	600072	中船股份	15,136,337.69	3.71
133	002664	信质电机	15,049,971.44	3.69
134	300059	东方财富	14,971,584.98	3.67
135	002701	奥瑞金	14,898,896.57	3.65
136	300136	信维通信	14,823,891.30	3.63
137	600109	国金证券	14,758,556.37	3.61
138	600184	光电股份	14,738,903.63	3.61
139	300005	探路者	14,728,799.89	3.61
140	600118	中国卫星	14,669,829.61	3.59
141	300015	爱尔眼科	14,652,549.29	3.59
142	300071	华谊嘉信	14,634,568.31	3.58
143	002646	青青稞酒	14,230,361.05	3.49
144	600867	通化东宝	14,159,960.35	3.47
145	601288	农业银行	13,991,785.00	3.43
146	300322	硕贝德	13,962,627.00	3.42
147	600557	康缘药业	13,884,548.12	3.40
148	000776	广发证券	13,782,454.92	3.38
149	002368	太极股份	13,770,756.77	3.37
150	600292	中电远达	13,662,828.65	3.35
151	002385	大北农	13,452,791.63	3.30
152	002416	爱施德	13,424,257.14	3.29
153	600832	东方明珠	13,366,641.37	3.27
154	300145	南方泵业	13,248,095.01	3.24
155	600879	航天电子	13,216,310.00	3.24
156	002594	比亚迪	13,095,324.80	3.21

157	000895	双汇发展	12,976,292.45	3.18
158	300079	数码视讯	12,958,748.94	3.17
159	300287	飞利信	12,834,518.58	3.14
160	002294	信立泰	12,674,845.17	3.10
161	601901	方正证券	12,610,867.02	3.09
162	002433	太安堂	12,448,333.98	3.05
163	600066	宇通客车	12,435,814.36	3.05
164	601311	骆驼股份	12,430,633.12	3.04
165	601222	林洋电子	12,426,844.79	3.04
166	000525	红太阳	12,405,888.77	3.04
167	300144	宋城股份	12,405,382.21	3.04
168	000811	烟台冰轮	12,267,294.98	3.00
169	600633	浙报传媒	12,061,982.00	2.95
170	601699	潞安环能	11,986,929.26	2.94
171	600872	中炬高新	11,897,419.56	2.91
172	002419	天虹商场	11,884,613.94	2.91
173	002158	汉钟精机	11,866,902.00	2.91
174	600067	冠城大通	11,743,582.01	2.88
175	000917	电广传媒	11,605,154.37	2.84
176	600702	沱牌舍得	11,555,615.06	2.83
177	002138	顺络电子	11,490,989.68	2.81
178	000826	桑德环境	11,431,187.99	2.80
179	300336	新文化	11,375,085.72	2.79
180	601601	中国太保	11,364,325.65	2.78
181	600527	江南高纤	11,345,869.08	2.78
182	002315	焦点科技	11,323,104.06	2.77
183	300002	神州泰岳	11,284,555.28	2.76
184	600893	航空动力	11,164,536.50	2.73
185	000333	美的集团	11,143,824.62	2.73
186	600389	江山股份	11,107,363.16	2.72
187	002653	海思科	11,050,934.21	2.71
188	002375	亚厦股份	10,868,410.96	2.66
189	300049	福瑞股份	10,767,250.85	2.64
190	002436	兴森科技	10,755,702.35	2.63
191	000581	威孚高科	10,751,189.28	2.63
192	300315	掌趣科技	10,588,939.88	2.59
193	600276	恒瑞医药	10,533,838.39	2.58
194	002287	奇正藏药	10,521,716.75	2.58
195	601965	中国汽研	10,458,419.65	2.56
196	002106	莱宝高科	10,430,776.01	2.55
197	600498	烽火通信	10,325,141.60	2.53
198	002508	老板电器	10,266,403.32	2.51

199	000786	北新建材	10,249,221.07	2.51
200	002065	东华软件	10,243,230.11	2.51
201	600335	国机汽车	10,184,631.62	2.49
202	600309	万华化学	10,103,243.31	2.47
203	300207	欣旺达	10,054,960.64	2.46
204	300080	新大新材	9,832,360.17	2.41
205	300020	银江股份	9,801,118.47	2.40
206	002550	千红制药	9,641,176.50	2.36
207	600596	新安股份	9,626,752.14	2.36
208	600261	阳光照明	9,616,665.79	2.36
209	600499	科达机电	9,522,289.05	2.33
210	002334	英威腾	9,473,252.18	2.32
211	300037	新宙邦	9,340,812.53	2.29
212	002219	独一味	9,323,357.45	2.28
213	000732	泰禾集团	9,262,932.53	2.27
214	300150	世纪瑞尔	9,226,920.83	2.26
215	300197	铁汉生态	9,187,296.57	2.25
216	300041	回天胶业	9,165,414.51	2.24
217	002344	海宁皮城	9,136,929.86	2.24
218	300003	乐普医疗	9,131,731.28	2.24
219	601928	凤凰传媒	9,115,348.00	2.23
220	002309	中利科技	9,084,930.36	2.23
221	002055	得润电子	9,035,563.97	2.21
222	000938	紫光股份	8,908,665.60	2.18
223	300012	华测检测	8,870,220.33	2.17
224	002244	滨江集团	8,859,946.43	2.17
225	600199	金种子酒	8,852,993.12	2.17
226	002462	嘉事堂	8,756,476.97	2.14
227	601126	四方股份	8,739,369.73	2.14
228	600271	航天信息	8,699,407.13	2.13
229	601988	中国银行	8,696,006.20	2.13
230	000012	南玻A	8,479,252.02	2.08
231	002223	鱼跃医疗	8,444,571.37	2.07
232	600588	用友软件	8,437,486.73	2.07
233	600880	博瑞传播	8,420,516.87	2.06
234	000800	一汽轿车	8,327,220.77	2.04
235	600983	合肥三洋	8,260,610.62	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	600016	民生银行	106,016,840.61	25.97
2	600585	海螺水泥	98,220,416.36	24.06
3	600837	海通证券	95,565,645.04	23.41
4	300027	华谊兄弟	70,576,943.30	17.29
5	000002	万科A	69,038,633.50	16.91
6	300104	乐视网	68,622,521.56	16.81
7	300058	蓝色光标	66,729,968.44	16.34
8	601166	兴业银行	64,983,978.30	15.92
9	603000	人民网	63,587,107.48	15.57
10	000001	平安银行	63,476,463.84	15.55
11	002241	歌尔声学	61,163,293.02	14.98
12	002415	海康威视	60,577,115.72	14.84
13	600104	上汽集团	59,430,699.82	14.56
14	300074	华平股份	55,942,852.41	13.70
15	600030	中信证券	54,312,681.17	13.30
16	600518	康美药业	54,042,166.60	13.24
17	600000	浦发银行	52,237,496.17	12.79
18	002450	康得新	51,805,623.53	12.69
19	000538	云南白药	50,332,076.20	12.33
20	002400	省广股份	49,958,400.16	12.24
21	600535	天士力	49,443,604.58	12.11
22	000024	招商地产	48,965,669.75	11.99
23	002236	大华股份	48,406,600.58	11.86
24	000661	长春高新	47,998,334.35	11.76
25	300070	碧水源	47,840,655.77	11.72
26	000651	格力电器	47,770,002.56	11.70
27	002456	欧菲光	46,041,110.66	11.28
28	601318	中国平安	45,610,913.93	11.17
29	300273	和佳股份	45,363,911.62	11.11
30	000625	长安汽车	44,834,589.86	10.98
31	300124	汇川技术	44,426,813.31	10.88
32	300017	网宿科技	44,406,787.07	10.88
33	002230	科大讯飞	43,882,825.02	10.75
34	300168	万达信息	42,143,539.65	10.32
35	300026	红日药业	41,468,444.23	10.16
36	600315	上海家化	41,262,403.15	10.11
37	300157	恒泰艾普	40,443,057.49	9.91
38	601299	中国北车	40,397,887.00	9.89
39	002353	杰瑞股份	40,369,924.79	9.89
40	300228	富瑞特装	40,251,206.56	9.86
41	600383	金地集团	39,910,717.57	9.78
42	002271	东方雨虹	39,802,166.75	9.75

43	601766	中国南车	39,459,641.28	9.66
44	600519	贵州茅台	38,792,505.35	9.50
45	600887	伊利股份	38,447,610.10	9.42
46	600804	鹏博士	38,404,900.04	9.41
47	002482	广田股份	37,853,122.46	9.27
48	600048	保利地产	37,706,394.79	9.24
49	002221	东华能源	37,436,481.22	9.17
50	600703	三安光电	34,895,271.98	8.55
51	601633	长城汽车	33,581,880.44	8.23
52	600637	百视通	33,577,002.85	8.22
53	002475	立讯精密	32,978,004.10	8.08
54	002570	贝因美	32,197,322.06	7.89
55	002273	水晶光电	31,853,183.97	7.80
56	300251	光线传媒	31,522,349.09	7.72
57	000400	许继电气	29,816,060.54	7.30
58	300024	机器人	29,687,004.34	7.27
59	002146	荣盛发展	29,064,592.87	7.12
60	002410	广联达	28,684,584.64	7.03
61	600332	白云山	28,311,559.30	6.93
62	002310	东方园林	28,237,563.24	6.92
63	300253	卫宁软件	28,174,181.40	6.90
64	000049	德赛电池	28,116,007.97	6.89
65	600406	国电南瑞	28,106,827.56	6.88
66	300146	汤臣倍健	27,737,683.32	6.79
67	300088	长信科技	27,591,913.81	6.76
68	002405	四维图新	27,093,298.46	6.64
69	600028	中国石化	27,046,715.06	6.62
70	601628	中国人寿	27,000,283.03	6.61
71	600597	光明乳业	26,994,980.52	6.61
72	600036	招商银行	26,392,925.81	6.46
73	600690	青岛海尔	26,110,663.78	6.40
74	002573	国电清新	24,831,678.51	6.08
75	002635	安洁科技	24,554,175.59	6.01
76	600079	人福医药	24,216,970.71	5.93
77	600570	恒生电子	23,944,786.82	5.86
78	601939	建设银行	23,936,469.33	5.86
79	600418	江淮汽车	23,915,333.81	5.86
80	600521	华海药业	23,450,486.65	5.74
81	300090	盛运股份	23,163,514.71	5.67
82	000671	阳光城	23,009,590.55	5.64
83	002292	奥飞动漫	22,746,728.13	5.57
84	600252	中恒集团	22,710,040.05	5.56

85	600150	中国船舶	22,542,792.11	5.52
86	600196	复星医药	22,514,918.82	5.51
87	600835	上海机电	22,495,067.34	5.51
88	002038	双鹭药业	22,185,039.80	5.43
89	002081	金螳螂	21,638,883.14	5.30
90	600372	中航电子	21,534,596.35	5.27
91	002566	益盛药业	21,308,984.37	5.22
92	600583	海油工程	21,306,279.02	5.22
93	300347	泰格医药	21,171,815.02	5.19
94	002439	启明星辰	21,080,791.13	5.16
95	000050	深天马 A	20,578,822.49	5.04
96	600256	广汇能源	20,520,121.16	5.03
97	000915	山大华特	20,492,727.81	5.02
98	600809	山西汾酒	20,360,414.08	4.99
99	600587	新华医疗	20,347,595.24	4.98
100	000748	长城信息	19,845,608.95	4.86
101	002440	闰土股份	19,514,615.22	4.78
102	000338	潍柴动力	19,435,641.89	4.76
103	600123	兰花科创	19,258,580.47	4.72
104	300147	香雪制药	19,098,135.78	4.68
105	002305	南国置业	18,951,908.51	4.64
106	300274	阳光电源	18,810,397.77	4.61
107	600999	招商证券	18,688,634.84	4.58
108	600109	国金证券	18,344,557.58	4.49
109	002294	信立泰	18,337,334.33	4.49
110	002005	德豪润达	18,190,305.24	4.46
111	000063	中兴通讯	18,186,135.50	4.45
112	002191	劲嘉股份	18,064,866.33	4.42
113	300014	亿纬锂能	18,040,140.12	4.42
114	300212	易华录	18,003,396.85	4.41
115	300133	华策影视	17,905,323.05	4.39
116	601336	新华保险	17,882,591.58	4.38
117	300300	汉鼎股份	17,766,212.58	4.35
118	002572	索菲亚	17,606,504.07	4.31
119	002024	苏宁云商	17,571,614.90	4.30
120	600801	华新水泥	16,746,639.49	4.10
121	000550	江铃汽车	16,497,270.23	4.04
122	600157	永泰能源	16,260,802.50	3.98
123	600089	特变电工	16,258,756.32	3.98
124	300059	东方财富	16,191,128.16	3.97
125	600900	长江电力	16,176,650.31	3.96
126	000540	中天城投	16,156,828.81	3.96



127	002063	远光软件	16,091,759.65	3.94
128	601699	潞安环能	15,973,160.09	3.91
129	300071	华谊嘉信	15,945,784.70	3.91
130	002416	爱施德	15,863,921.81	3.89
131	601877	正泰电器	15,699,870.13	3.85
132	000786	北新建材	15,680,656.59	3.84
133	300257	开山股份	15,497,468.45	3.80
134	600072	中船股份	15,495,324.29	3.80
135	000596	古井贡酒	15,473,397.04	3.79
136	601601	中国太保	15,345,232.48	3.76
137	600309	万华化学	15,321,689.24	3.75
138	300182	捷成股份	15,258,300.65	3.74
139	600867	通化东宝	15,234,196.11	3.73
140	600557	康缘药业	15,173,744.45	3.72
141	300205	天喻信息	15,147,255.01	3.71
142	600118	中国卫星	14,887,280.04	3.65
143	600184	光电股份	14,727,365.12	3.61
144	002701	奥瑞金	14,471,329.90	3.54
145	600292	中电远达	14,228,646.06	3.49
146	002368	太极股份	14,148,829.64	3.47
147	002664	信质电机	14,045,620.47	3.44
148	300136	信维通信	13,934,442.24	3.41
149	002646	青青稞酒	13,691,581.57	3.35
150	300315	掌趣科技	13,675,761.08	3.35
151	300285	国瓷材料	13,423,344.64	3.29
152	300079	数码视讯	13,402,547.70	3.28
153	600832	东方明珠	13,330,520.26	3.27
154	601288	农业银行	13,192,595.00	3.23
155	300015	爱尔眼科	13,170,877.98	3.23
156	300336	新文化	12,944,026.07	3.17
157	002433	太安堂	12,920,159.56	3.16
158	002594	比亚迪	12,745,295.47	3.12
159	300145	南方泵业	12,665,468.12	3.10
160	000525	红太阳	12,645,382.70	3.10
161	600067	冠城大通	12,624,949.59	3.09
162	600879	航天电子	12,527,794.91	3.07
163	300075	数字政通	12,497,351.76	3.06
164	300144	宋城股份	12,468,508.34	3.05
165	601222	林洋电子	12,350,717.22	3.03
166	002385	大北农	12,332,954.38	3.02
167	600872	中炬高新	12,321,500.15	3.02
168	600066	宇通客车	12,192,742.41	2.99

169	601311	骆驼股份	12,090,831.07	2.96
170	000826	桑德环境	12,086,550.79	2.96
171	000895	双汇发展	12,013,225.94	2.94
172	002419	天虹商场	11,948,801.95	2.93
173	300287	飞利信	11,909,445.36	2.92
174	002106	莱宝高科	11,837,826.12	2.90
175	002138	顺络电子	11,834,499.87	2.90
176	000917	电广传媒	11,629,127.53	2.85
177	600893	航空动力	11,291,921.25	2.77
178	300002	神州泰岳	11,287,861.47	2.76
179	300207	欣旺达	11,031,484.23	2.70
180	002436	兴森科技	10,892,251.53	2.67
181	600389	江山股份	10,636,969.25	2.61
182	600702	沱牌舍得	10,519,314.22	2.58
183	300322	硕贝德	10,509,427.02	2.57
184	000333	美的集团	10,492,680.65	2.57
185	002375	亚厦股份	10,372,181.72	2.54
186	002065	东华软件	10,247,602.67	2.51
187	600596	新安股份	10,160,440.86	2.49
188	600143	金发科技	10,147,113.88	2.49
189	002653	海思科	9,969,619.36	2.44
190	002250	联化科技	9,930,163.59	2.43
191	002477	雏鹰农牧	9,871,042.97	2.42
192	300005	探路者	9,854,778.27	2.41
193	002315	焦点科技	9,813,479.60	2.40
194	601117	中国化学	9,728,793.98	2.38
195	002287	奇正藏药	9,714,120.03	2.38
196	600498	烽火通信	9,565,038.99	2.34
197	600261	阳光照明	9,537,171.69	2.34
198	300049	福瑞股份	9,486,758.63	2.32
199	002309	中利科技	9,432,206.40	2.31
200	300037	新宙邦	9,314,316.54	2.28
201	600499	科达机电	9,307,108.18	2.28
202	300197	铁汉生态	9,255,291.09	2.27
203	600335	国机汽车	9,227,666.40	2.26
204	000938	紫光股份	9,162,540.00	2.24
205	002334	英威腾	9,153,043.31	2.24
206	300096	易联众	9,142,993.15	2.24
207	300020	银江股份	9,132,170.08	2.24
208	002508	老板电器	9,078,506.02	2.22
209	300080	新大新材	8,965,668.65	2.20
210	300150	世纪瑞尔	8,920,648.60	2.18

211	002550	千红制药	8,918,816.92	2.18
212	601928	凤凰传媒	8,910,137.88	2.18
213	300003	乐普医疗	8,837,305.14	2.16
214	002055	得润电子	8,818,281.32	2.16
215	002244	滨江集团	8,784,648.99	2.15
216	002344	海宁皮城	8,705,163.54	2.13
217	002174	梅花伞	8,700,086.57	2.13
218	600271	航天信息	8,693,569.53	2.13
219	300012	华测检测	8,690,788.81	2.13
220	000732	泰禾集团	8,655,845.60	2.12
221	002462	嘉事堂	8,613,927.62	2.11
222	601126	四方股份	8,473,690.37	2.08
223	300072	三聚环保	8,393,591.01	2.06
224	600880	博瑞传播	8,316,793.03	2.04
225	300083	劲胜股份	8,187,601.52	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	6,086,004,795.43
卖出股票收入（成交）总额	6,014,508,223.33

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	29,835,000.00	5.38
	其中：政策性金融债	29,835,000.00	5.38
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	29,835,000.00	5.38

#### 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	130227	13 国开 27	200,000	19,836,000.00	3.57
2	130201	13 国开 01	100,000	9,999,000.00	1.80

**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 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：**

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、报告期内，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的，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中，无投资于基金合同规定备选股票库之外的股票。

**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	874,385.14
2	应收证券清算款	19,652,549.89
3	应收股利	-
4	应收利息	710,949.01
5	应收申购款	50,035.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,287,919.60

#### 8.11.4 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。

#### 8.11.5 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
18,779	39,703.04	168,900,918.26	22.65%	576,682,437.98	77.35%

#### 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	711,641.03	0.0955%

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 至 10 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

单位：份

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	606,105,500.59
本报告期基金总申购份额	431,814,832.49
减：本报告期基金总赎回份额	292,336,976.84
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	745,583,356.24

## § 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

本报告期内，基金管理人、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），该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今，本年度应支付的审计费用为 65,000.00 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	
长江证券	2	8,373,899,341.44	69.24%	7,470,363.85	68.99%	-
长城证券	1	1,232,049,100.20	10.19%	1,121,654.56	10.36%	-
中投证券	1	1,180,677,522.86	9.76%	1,044,784.05	9.65%	-
宏源证券	1	688,184,298.33	5.69%	626,521.95	5.79%	-
第一创业	1	620,003,755.93	5.13%	564,450.18	5.21%	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
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) 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，并能为本基金提供全面的信息服；

(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、本基金本报告期内新租用宏源证券 1 个和广州证券 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	1,342,608.21	31.87%	270,000,000.00	37.19%	-	-
长城证券	-	-	30,000,000.00	4.13%	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	2,870,514.50	68.13%	426,000,000.00	58.68%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-

融通基金管理有限公司  
二〇一四年三月二十七日