

融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金
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通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金（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 8 月 30 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	融通通泽一年目标触发式混合
基金主代码	000278
交易代码	000278
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2013 年 8 月 30 日
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	869,304,088.98 份
基金合同存续期	本基金封闭运作，最长封闭期 1 年

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求本金安全的基础上，通过大类资产配置与个券选择，采用数量化手段严格控制本基金的下行风险，力争在减小波动性的同时有效时间内为投资者创造 8%的累计目标收益，为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。
投资策略	本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主

	动投资管理策略, 将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、行业细分、公司价值评估以及组合风险管理全过程中。
业绩比较基准	年化收益率 8%。
风险收益特征	本基金为混合型基金, 其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金, 低于股票型基金, 属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。

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	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 8 月 30 日(基金合同生效日)-2013 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-46,852,461.74
本期利润	-32,942,977.54
加权平均基金份额本期利润	-0.0379
本期基金份额净值增长率	-3.80%
3.1.2 期末数据和指标	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0539
期末基金资产净值	836,361,111.44
期末基金份额净值	0.962

注：1、本基金合同生效日为 2013 年 8 月 30 日，截止报告期末本基金合同生效未满一年，相关数据根据实际存续期计算；

2、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；

3、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；

4、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）。

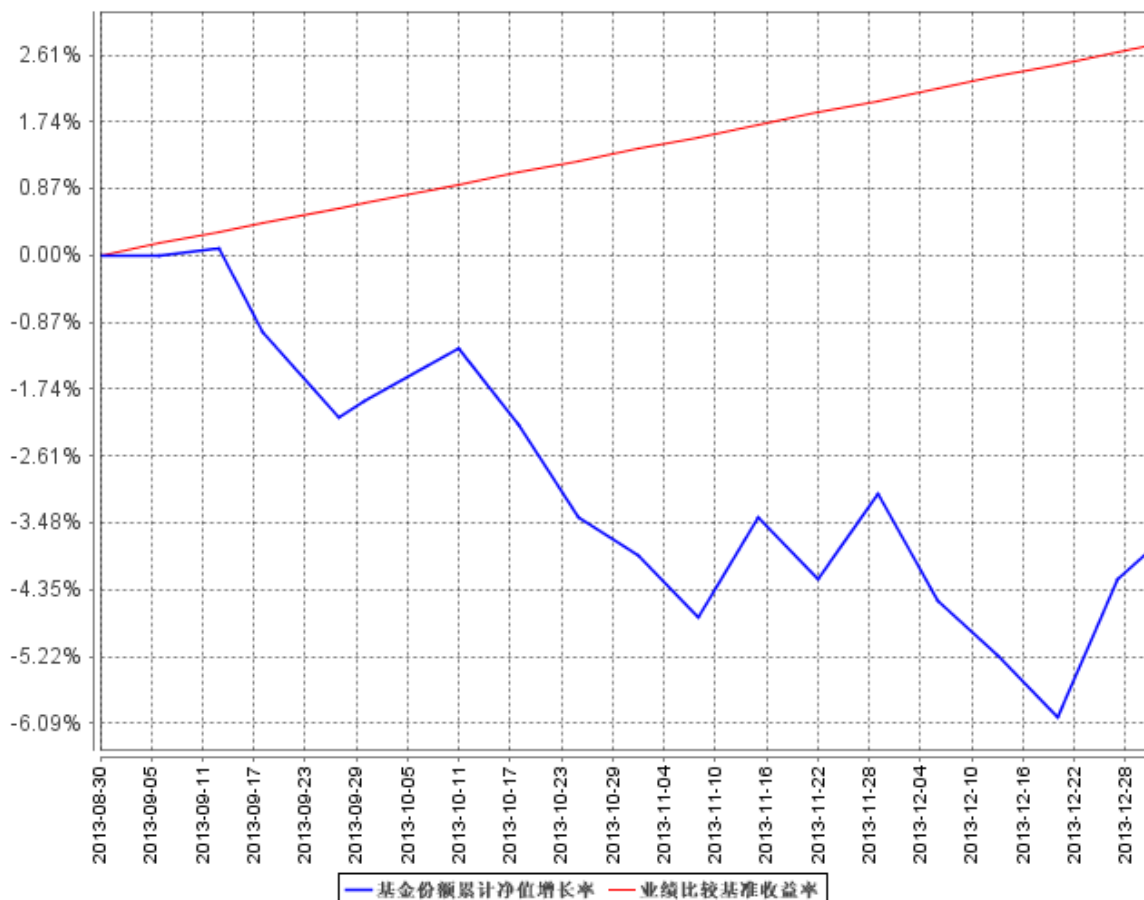
3.2 基金净值表现

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	-1.94%	0.49%	2.02%	0.00%	-3.96%	0.49%
自基金合同生效起至今	-3.80%	0.44%	2.72%	0.00%	-6.52%	0.44%

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

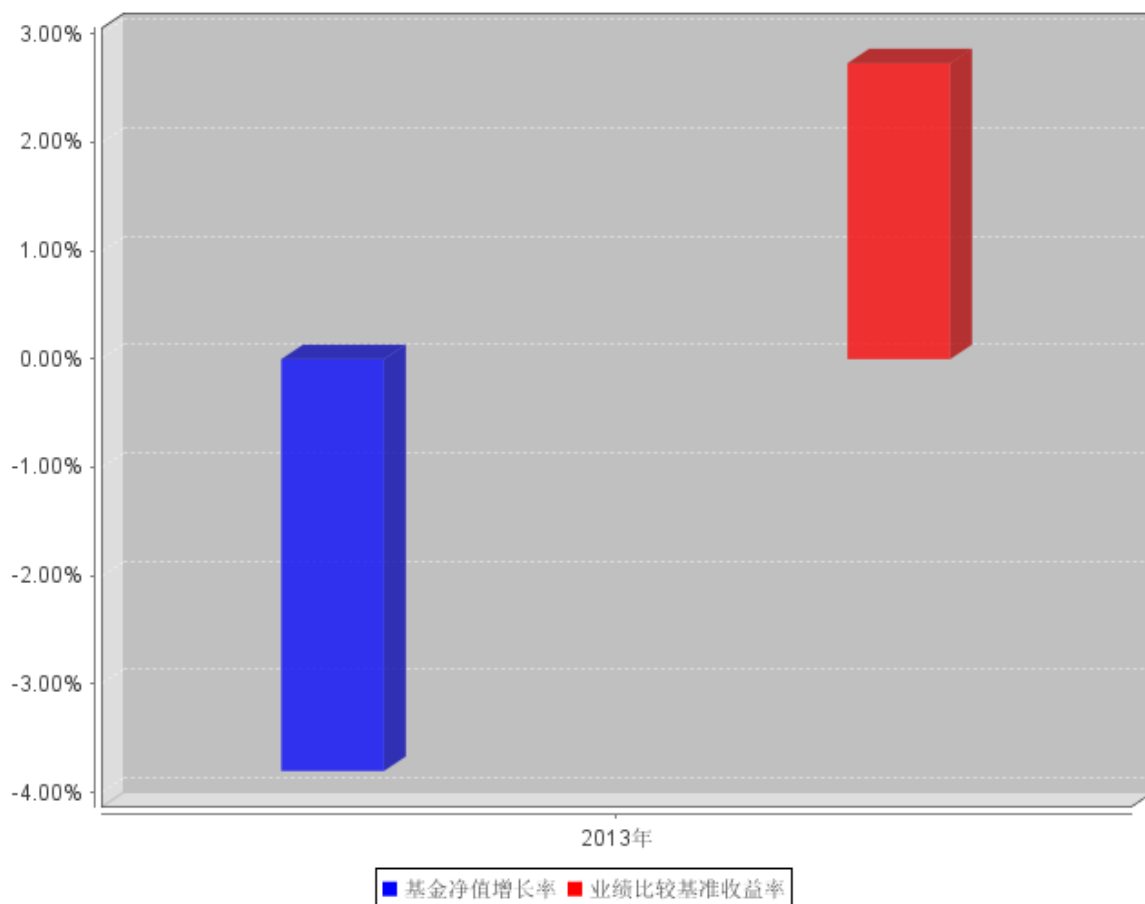
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金的基金合同生效日为 2013 年 8 月 30 日。截止本报告期末，基金成立未满一年；
2、本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月，截止本报告期末，本基金尚在建仓期。

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：本基金合同生效日为 2013 年 8 月 30 日，合同生效当年按实际存续期计算，未按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

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年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金合同生效日为 2013 年 8 月 30 日。

§ 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，即融通通乾封闭式基金；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		
周琚	本基金的基金经理、融通内需驱动及融通通源一年目标触发式混合的基金经理	2013 年 8 月 30 日	-	6	硕士，6 年证券从业经验，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、《融通通泽一年目标触发式灵活配置混合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

本基金于 2013 年 8 月 30 日成立，截止 2013 年底，正式运作已满一个季度。总体而言，由于建仓以来，A 股市场主流指数均取得负收益（上证下跌 7.1%，创业板指下跌 2.3%），在不断下行的市场中，本基金缺乏对冲工具，要获得正收益存在难度。但成立之后，基金操作中确实出现了两次较大失误，第一次在改革预期之下，追高了金融类资产造成负损失，第二次在创业板见顶后，本基金仍然持有了不少成长股，虽然尽可能寻找业绩稳定和估值匹配的个股，但依然难以获得正收益。

本基金没有在市场风险释放时完全清空仓位，而仍保留了 30-40%的底仓是造成亏损的最根本原因。往后看，虽然整体经济仍然受非标资产风险清理带来的信用风险释放、房地产投资后周期导致的产业链衰退等负面因素的影响，但经历了连续六年的不断下跌，A 股市场绝大部分股票对经济下行和改革中遇到的风险因素都有较好的反映。同时以移动互联网和医疗服务为代表的成长性行业有强大的内生消费做支撑。

本基金相信，虽然市场不会一帆风顺，但目前处于低位的概率较大，从各大类资产配置角度看，权益市场应该将在未来两三年取得最好的回报。因此，本基金仍然愿意持有一定仓位的底仓，

同时以行业趋势向上而业绩确定性较高的个股为基本配置，再结合市场的波动，逢低增持价值型蓝筹。

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-3.80%，同期业绩比较基准收益率为 2.72%。

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-0.0539 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通泽一年目标触发式灵活配置混合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，融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金的管理人——融通基金管理有限公司在融通通泽一年目标触发式灵活配置混合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。

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通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金 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 21328 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：融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金

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
资 产：	
银行存款	298,768,810.21
结算备付金	17,972,714.39
存出保证金	423,446.38
交易性金融资产	510,273,563.71
其中：股票投资	390,114,201.52
基金投资	-
债券投资	120,159,362.19
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	59,850,229.93
应收证券清算款	-
应收利息	2,199,064.86
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	889,487,829.48
负 债 和 所 有 者 权 益	本期末 2013 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	50,464,382.30
应付赎回款	-
应付管理人报酬	-
应付托管费	175,817.88
应付销售服务费	-
应付交易费用	2,310,517.86
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	176,000.00
负债合计	53,126,718.04
所 有 者 权 益：	
实收基金	869,304,088.98
未分配利润	-32,942,977.54

所有者权益合计	836,361,111.44
负债和所有者权益总计	889,487,829.48

注：1、报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.962 元，基金份额总额 869,304,088.98 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2013 年 8 月 30 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2013 年 8 月 30 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期
	2013 年 8 月 30 日(基金合同生效日) 至 2013 年 12 月 31 日
一、收入	-27,399,047.31
1. 利息收入	7,564,905.55
其中：存款利息收入	2,838,866.63
债券利息收入	1,698,691.51
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	3,027,347.41
其他利息收入	-
2. 投资收益	-48,875,286.94
其中：股票投资收益	-48,875,286.94
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3. 公允价值变动收益	13,909,484.20
4. 汇兑收益	-
5. 其他收入	1,849.88
减：二、费用	5,543,930.23
1. 管理人报酬	-
2. 托管费	711,575.23
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	4,651,634.00
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	180,721.00
三、利润总额	-32,942,977.54
减：所得税费用	-

四、净利润	-32,942,977.54
-------	----------------

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2013 年 8 月 30 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 8 月 30 日(基金合同生效日)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）	869,304,088.98	-	869,304,088.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-32,942,977.54	-32,942,977.54
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	869,304,088.98	-32,942,977.54	836,361,111.44

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	_____ 朱建华	_____ 刘美丽
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]944号《关于核准融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准,由融通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型封闭式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币868,810,282.67元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2013)第556号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2013年8月30日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为

869,304,088.98 份基金份额，其中认购资金利息折合 493,806.31 份基金份额。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）。

根据《融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金成立后封闭运作，不开放申购、赎回。在基金的累计份额净值触发“连续 3 个工作日不低于 1.10 元”的提前到期条件后，本基金提前到期，自触发提前到期条件后的次一工作日起，基金进入变现及清算程序。本基金最长封闭期为 1 年，即最长封闭期为基金合同生效日起至基金合同生效日年对日的期间，若本基金在最长封闭期内未触发提前到期条件，则本基金在最长封闭期结束后的次一工作日起进入变现及清算程序。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市交易的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、一级市场新股或增发的股票、权证、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金及到期日在一年以内的政府债券，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金业绩比较基准为年化收益率 8%。

根据《融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至 2013 年 12 月 31 日止，本基金尚处于建仓期。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2013 年 8 月 30 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年 8 月 30 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2013 年 8 月 30 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项, 包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时, 按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产, 取得时发生的相关交易费用计入当期损益; 对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息, 单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认

为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬在基金变现期结束日按基金合同约定的计算方式计提；本基金的托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.11 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 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”)	基金管理人的股东、基金代销机构
日兴资产管理有限公司	基金管理人的股东
深圳市融通资本财富管理有限公司	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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年8月30日(基金合同生效日)至2013年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
新时代证券	405,333,169.20	12.59%

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 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8月30日(基金合同生效日)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	369,013.28	12.77%	266,629.29	11.54%

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年8月30日(基金合同生效日)至2013年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	-
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：本基金的管理费按照基金变现期结束日的基金份额累计净值大小进行分段设置，一次性计提。本基金在到期前（包括提前到期或最长封闭期到期）不计提管理费。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2013 年 8 月 30 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	711,575.23

注：支付基金托管人中国工商银行的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：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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，基金管理人主要股东及其控制的机构均未持有本基金份额。

7.4.8.5 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 8 月 30 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	98,768,810.21	482,989.43

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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金本报告期末买入管理人、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、本基金本报告期末买入管理人、托管人的主要股东（非控股）在承销期内承销的证券。

7.4.8.7 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。

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

7.4.9.1 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/增发而流通受限的证券。

7.4.9.2 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

§ 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	390,114,201.52	43.86
	其中：股票	390,114,201.52	43.86
2	固定收益投资	120,159,362.19	13.51
	其中：债券	120,159,362.19	13.51
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	59,850,229.93	6.73
	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	316,741,524.60	35.61
6	其他各项资产	2,622,511.24	0.29
7	合计	889,487,829.48	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	-	-
C	制造业	243,511,371.48	29.12
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	20,182,800.00	2.41

	业		
J	金融业	97,037,530.04	11.60
K	房地产业	11,756,800.00	1.41
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	17,625,700.00	2.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	390,114,201.52	46.64

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	601318	中国平安	869,948	36,302,930.04	4.34
2	600587	新华医疗	510,000	35,654,100.00	4.26
3	002631	德尔家居	1,939,750	32,005,875.00	3.83
4	600535	天士力	569,918	24,443,783.02	2.92
5	002236	大华股份	560,000	22,892,800.00	2.74
6	600036	招商银行	2,100,000	22,869,000.00	2.73
7	300070	碧水源	430,000	17,625,700.00	2.11
8	000049	德赛电池	250,000	17,550,000.00	2.10
9	600030	中信证券	1,200,000	15,300,000.00	1.83
10	300017	网宿科技	180,000	15,246,000.00	1.82

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	88,454,929.77	10.58
2	000002	万科A	79,101,479.72	9.46

3	600000	浦发银行	67,671,278.52	8.09
4	601166	兴业银行	62,133,764.18	7.43
5	600585	海螺水泥	62,105,999.54	7.43
6	600016	民生银行	61,138,850.74	7.31
7	600104	上汽集团	60,053,699.19	7.18
8	000651	格力电器	56,191,178.96	6.72
9	300058	蓝色光标	54,259,674.59	6.49
10	300017	网宿科技	52,682,303.86	6.30
11	002191	劲嘉股份	48,673,014.85	5.82
12	600030	中信证券	44,367,050.11	5.30
13	000338	潍柴动力	42,962,693.86	5.14
14	002236	大华股份	41,499,954.23	4.96
15	002415	海康威视	39,068,455.75	4.67
16	600587	新华医疗	38,867,225.62	4.65
17	601601	中国太保	35,041,353.30	4.19
18	300070	碧水源	33,617,851.54	4.02
19	000400	许继电气	31,888,009.17	3.81
20	002631	德尔家居	31,075,459.56	3.72
21	600196	复星医药	31,064,095.05	3.71
22	601877	正泰电器	29,889,539.09	3.57
23	000001	平安银行	29,305,715.04	3.50
24	000538	云南白药	29,262,864.25	3.50
25	600518	康美药业	28,708,710.99	3.43
26	600072	中船股份	28,532,435.84	3.41
27	000024	招商地产	26,600,879.74	3.18
28	002701	奥瑞金	23,793,440.93	2.84
29	000550	江铃汽车	23,702,806.80	2.83
30	600535	天士力	23,584,737.20	2.82
31	600036	招商银行	22,707,843.05	2.72
32	601336	新华保险	22,223,334.62	2.66
33	300015	爱尔眼科	20,482,530.29	2.45
34	002241	歌尔声学	19,045,253.41	2.28
35	000049	德赛电池	18,008,476.94	2.15
36	600276	恒瑞医药	17,875,004.01	2.14
37	300027	华谊兄弟	16,881,199.10	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000002	万科A	73,868,403.64	8.83
2	600000	浦发银行	64,418,870.62	7.70
3	600104	上汽集团	59,867,570.07	7.16
4	600585	海螺水泥	59,857,645.25	7.16
5	000651	格力电器	59,382,605.07	7.10
6	600016	民生银行	56,464,562.91	6.75
7	601318	中国平安	52,484,026.63	6.28
8	300058	蓝色光标	49,136,144.68	5.87
9	002191	劲嘉股份	48,750,576.82	5.83
10	601166	兴业银行	46,276,541.48	5.53
11	000338	潍柴动力	43,184,623.11	5.16
12	002415	海康威视	37,458,819.52	4.48
13	300017	网宿科技	37,123,597.52	4.44
14	601601	中国太保	32,387,180.59	3.87
15	600196	复星医药	29,726,548.76	3.55
16	600072	中船股份	29,613,596.87	3.54
17	600518	康美药业	28,809,609.40	3.44
18	000400	许继电气	28,494,907.76	3.41
19	000001	平安银行	28,306,766.56	3.38
20	600030	中信证券	28,269,181.41	3.38
21	601877	正泰电器	28,111,635.28	3.36
22	000024	招商地产	25,968,498.31	3.10
23	000550	江铃汽车	24,681,987.92	2.95
24	000538	云南白药	24,654,477.55	2.95
25	002701	奥瑞金	22,089,322.42	2.64
26	601336	新华保险	20,466,542.62	2.45
27	600109	国金证券	18,184,362.57	2.17
28	300015	爱尔眼科	18,136,484.53	2.17
29	002236	大华股份	17,423,866.88	2.08

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	1,822,916,137.19
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	1,397,603,837.04
--------------	------------------

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	120,159,362.19	14.37
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	120,159,362.19	14.37

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	124346	13 乳国资	400,000	40,196,000.00	4.81
2	124387	13 湛基投	400,000	39,981,773.15	4.78
3	123012	13 哈高新债	400,000	39,981,589.04	4.78

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

8.11.2 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	423,446.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,199,064.86
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,622,511.24

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	户均持有的	持有人结构
-------	-------	-------

(户)	基金份额	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
7,044	123,410.57	49,999,000.00	5.75%	819,305,088.98	94.25%

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	610,853.99	0.0703%

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 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 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)，本年度应支付的审计费为人民币 76,000.00 元。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
广州证券	2	567,227,972.53	17.61%	506,243.75	17.52%	-
海通证券	1	544,014,268.73	16.89%	481,401.55	16.66%	-
中信证券	1	461,226,786.25	14.32%	408,139.53	14.12%	-
新时代证券	1	405,333,169.20	12.59%	369,013.28	12.77%	-
中信建投	1	270,721,196.86	8.41%	246,461.88	8.53%	-
安信证券	2	253,157,653.70	7.86%	228,452.21	7.90%	-
申银万国	1	251,796,664.58	7.82%	229,235.57	7.93%	-
华鑫证券	1	216,215,345.56	6.71%	196,840.69	6.81%	-
中金公司	1	107,662,529.04	3.34%	95,270.40	3.30%	-
中航证券	1	48,771,142.84	1.51%	44,401.49	1.54%	-
平安证券	2	47,256,876.41	1.47%	43,022.04	1.49%	-
中山证券	2	32,774,060.94	1.02%	29,001.74	1.00%	-
华泰证券	1	14,362,307.59	0.45%	12,709.12	0.44%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-

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

- (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

本基金交易单元均为本报告期新增交易单元，无其他变更。

10.7.2 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
广州证券	-	-	1,970,000,000.00	11.85%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	4,705,000,000.00	28.30%	-	-
中信建投	-	-	2,134,900,000.00	12.84%	-	-
安信证券	-	-	1,707,000,000.00	10.27%	-	-
申银万国	-	-	2,991,000,000.00	17.99%	-	-
华鑫证券	-	-	2,560,000,000.00	15.40%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	380,000,000.00	2.29%	-	-
平安证券	-	-	180,000,000.00	1.08%	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-

融通基金管理有限公司
二〇一四年三月二十七日