

融通领先成长股票型证券投资基金 (LOF)

2014 年年度报告摘要

2014 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2015 年 3 月 26 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据融通领先成长股票型证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”) 基金合同规定，于 2015 年 3 月 19 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 2014 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 | 融通领先成长股票 (LOF) |
| 场内简称 | 融通领先 |
| 基金主代码 | 161610 |
| 前端交易代码 | 161610 |
| 后端交易代码 | 161660 |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式 (LOF) |
| 基金合同生效日 | 2007 年 4 月 30 日 |
| 基金管理人 | 融通基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,432,760,950.13 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2007 年 7 月 18 日 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金主要投资于业绩能持续高速增长的上市公司，通过积极主动的分散化投资策略，在严格控制风险的前提下实现基金资产的持续增长，为基金持有人获取 |
|------|---|

| | |
|--------|--|
| | 长期稳定的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金认为股价的上升的主要推动力来自于企业盈利的不断增长。在中国经济长期高速增长的大背景下,许多企业在一定时期表现出较高的成长性,但只有符合产业结构发展趋势,同时在技术创新、经营模式、品牌、渠道、成本等方面具有领先优势的企业,才能保持业绩持续高速增长,而这些企业正是本基金重点投资的目标和获得长期超额回报的基础。 |
| 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 | 本基金是较高预期收益较高预期风险的产品,其预期收益与风险高于混合基金、债券基金与货币市场基金。 |

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 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 涂卫东 | 田青 |
| | 联系电话 | (0755) 26948666 | (010) 67595096 |
| | 电子邮箱 | service@mail.rtfund.com | tianqingl.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 400-883-8088、(0755) 26948088 | (010) 67595096 |
| 传真 | | (0755) 26935005 | (010) 66275853 |

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、深圳证券交易所 |

§ 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 | 2014 年 | 2013 年 | 2012 年 |
|---------------|------------------|------------------|------------------|
| 本期已实现收益 | 290,790,784.13 | 83,235,580.16 | -567,246,867.38 |
| 本期利润 | -4,514,570.13 | 159,172,841.00 | -134,598,206.64 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0016 | 0.0481 | -0.0356 |
| 本期基金份额净值增长率 | -0.55% | 6.09% | -4.83% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2014 年末 | 2013 年末 | 2012 年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0147 | -0.1211 | -0.1450 |
| 期末基金资产净值 | 1,770,155,582.15 | 2,270,104,444.78 | 2,528,647,398.30 |
| 期末基金份额净值 | 0.728 | 0.732 | 0.690 |

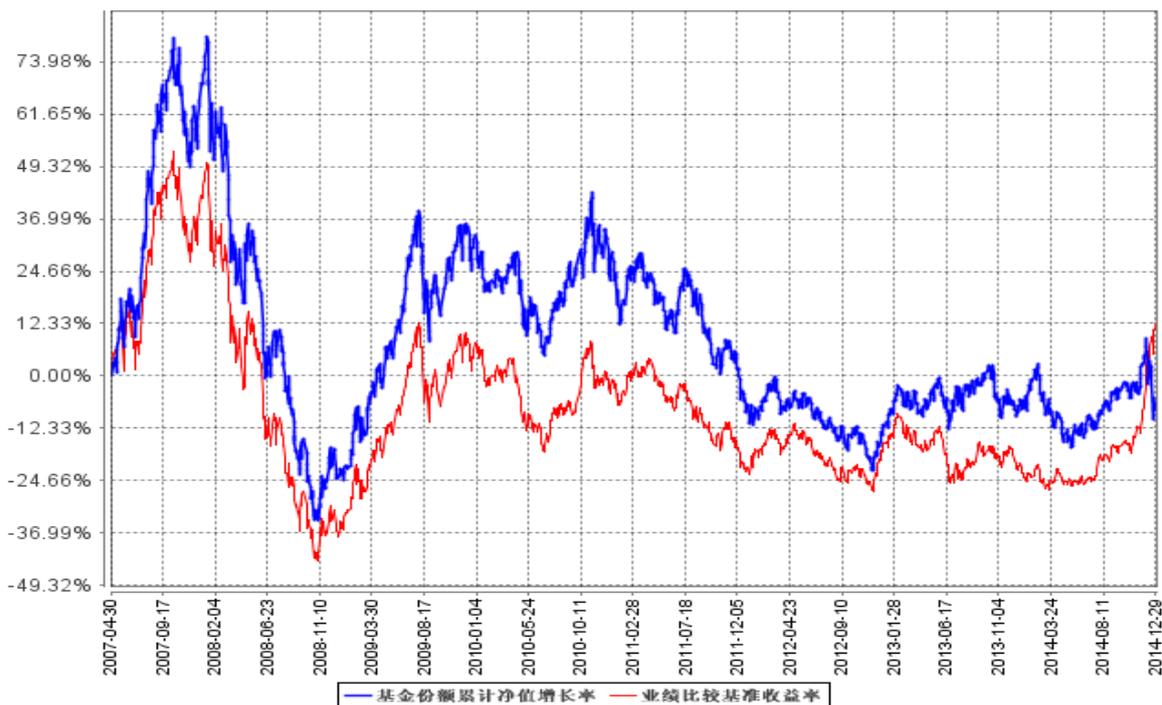
3.2 基金净值表现

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 | -4.21% | 1.72% | 35.13% | 1.34% | -39.34% | 0.38% |
| 过去六个月 | 4.00% | 1.32% | 49.78% | 1.07% | -45.78% | 0.25% |
| 过去一年 | -0.55% | 1.27% | 42.46% | 0.98% | -43.01% | 0.29% |
| 过去三年 | 0.41% | 1.22% | 44.30% | 1.04% | -43.89% | 0.18% |
| 过去五年 | -29.83% | 1.27% | 5.03% | 1.09% | -34.86% | 0.18% |
| 自基金合同生效起至今 | -5.47% | 1.60% | 13.24% | 1.49% | -18.71% | 0.11% |

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

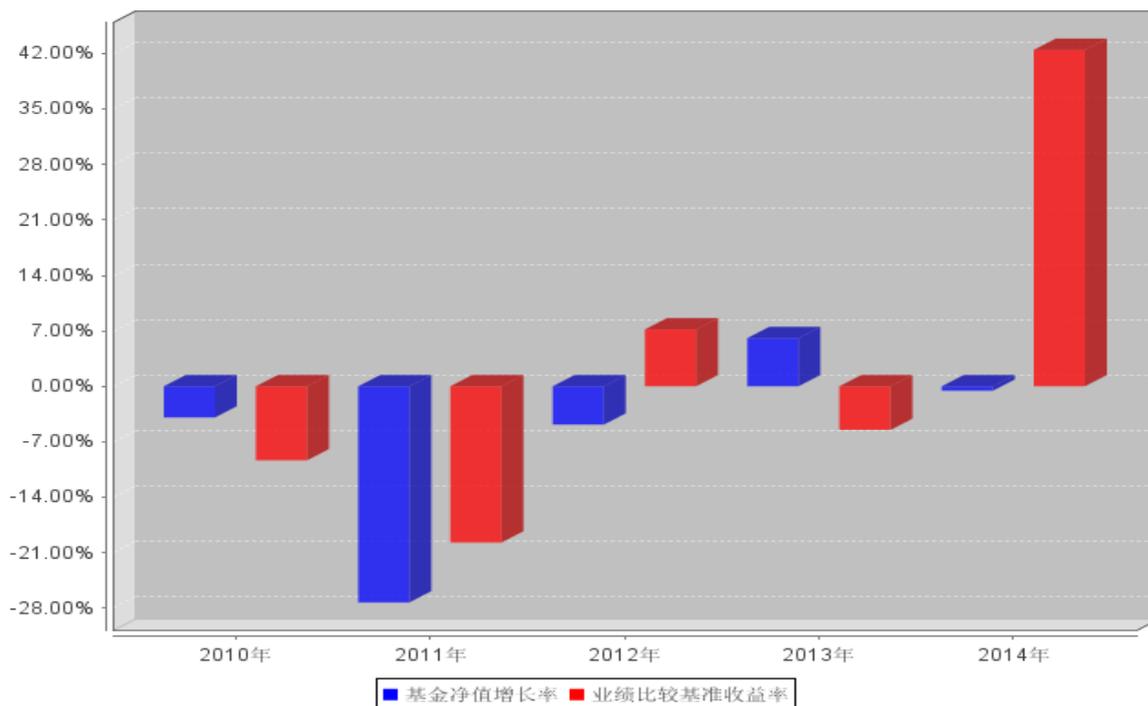
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金是由原通宝证券投资基金转型而来，转型日期为 2007 年 4 月 30 日。

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

| 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 |
|------|-------------|----------|-----------|----------|----|
| 2014 | - | - | - | - | - |
| 2013 | - | - | - | - | - |
| 2012 | - | - | - | - | - |
| 合计 | - | - | - | - | - |

§ 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2014年12月31日，公司管理的基金共有二十六只：一只封闭式基金，即融通通乾封闭基金；二十五只开放式基金，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、

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、融通通泽混合基金、融通通福分级债券基金、融通通源短融债券基金、融通通瑞债券基金、融通月月添利基金和融通健康产业基金。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 | | |
| 刘格菘 | 本基金的基金经理 | 2014年12月24日 | | 5 | 经济学博士,毕业于中国人民银行研究生部,曾任职于中国人民银行营业管理部,历任中邮创业基金基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、中邮核心成长股票型证券投资基金基金经理。2014年9月加入融通基金管理有限公司。 |
| 余志勇 | 本基金的基金经理 | 2012年8月10日 | 2014年12月24日 | 15 | 金融学硕士,具有证券从业资格。先后任职于湖北省农业厅、闽发证券,2004年加入招商证券股份有限公司研究发展中心,从事房地产行业研究工作。2007年加入融通基金管理有限公司,曾任研究部行业研究员、行业组长。 |

注:任职日期和离任日期均根据基金管理人对外披露的任免日期填写;证券从业年限以从事证券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、《融通领先成长股票型证券投资基金(LOF)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

2014年，我国宏观经济始终笼罩在通货紧缩的阴影下，PPI连续负增长，一方面源于制造业的产能过剩，另一方面源于国际大宗商品价格的低迷。外围经济体复苏道路曲折，美国经济率先走出低迷，美联储的加息预期又导致了全球资金从新兴经济体向美国回流，强势的美元和中国经济暗淡的前景始终压制着全球大宗商品价格。地缘政治因素也导致了大宗商品价格的黑天鹅事件：西方国家对俄罗斯的制裁导致国际原油价格大幅下滑，而OPEC国家的坚持不减产计划，使得全球以页岩气、新能源汽车代表的新兴能源行业前景不明朗。在这种宏观背景下，我国的GDP增速没有触底迹象，上市公司2014年前三季度财报显示，周期性行业的盈利增速逐季下滑，因此前三季度机构投资者在周期性行业的资金配置较低。2014年，房地产行业的大周期拐点的趋势被市场认同，尽管针对房地产行业的调控措施在不断放松，但房地产销售增速直到2014年底才略有好转。我们认为，房地产行业需求的趋势性变化对中国宏观经济、资本市场的影响深远，一方面，房地产相关行业占GDP的比例较高，房地产的趋势性拐点意味着地产相关行业盈利增速的趋势性改变；另一方面，房地产需求的拐点意味着居民中长期资产配置方向的变化。正是后者（此外还有金融创新带来的杠杆提高）推动了2014年4季度A股市场低估值板块的趋势性上升行情。我们认为，

4 季度的走势是估值修复行情，是市场对于成长股与周期股配置偏离度达到极致情况下的一种均值回归行情，并不是宏观经济触底使得企业盈利发生拐点性变化带来的业绩推动行情。

本基金围绕经济转型的大背景，寻找中长期成长趋势确定性较强的行业，自下而上精选个股，按照企业家战略、管理层执行力、所在行业细分市场空间、企业竞争力几个角度，挖掘成长空间巨大的公司，伴随公司成长并获得长期投资回报。2010 年以来，移动互联技术的发展将信息传播速度推向了新高度，信息传播方式的改变也极大的改变了人们的生活习惯和企业经营环境和商业环境。对于消费者来讲，餐饮、游戏、阅读、聚会、邮件、健康医疗以及支付等需求都可以通过一个带在身边的智能终端来实现，对于企业来讲，办公、供应商信息、产品需求信息、生产车间运行状况等信息也可以集成到一个智能终端上。智能终端渗透率的不断提高以及移动互联用户的加速普及，意味着信息获取方式以及可用信息数量的巨大变化，可以说，信息深度互联彻底改变了全球分工体系和客户的需求响应机制，改变了行业、企业的边界条件，也给企业的外部商业环境带来了深刻影响。站在目前这个时点看，这种趋势性的变化可能才刚刚开始。从 2012 年以来，互联网相关行业的商业模式创新不断，传统行业也积极拥抱互联网，利用互联网改造传统的商业模式，既提升了企业运作效率，也提升了企业价值。我们认为，在这个确定性趋势的行业会产生很多具备投资价值的公司，本基金的投资紧紧围绕互联网相关的行业展开。

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-0.55%，同期业绩比较基准收益率为 42.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为，2015 年的宏观经济走势很难发生趋势性的变化，全年 GDP 增速在 7.00%-7.50% 之间的概率较大。2015 年需要关注的宏观变量有两个：一是“一路一带”政策对产能过剩的制造业需求的拉动作用；二是国企改革对于周期性国有企业的效率提升作用。

我们认为，居民资产配置的改变是一个缓慢的过程，对资本市场的推动作用依然较强，但由于 2014 年 4 季度市场的快速上升伴随着较为明显的杠杆提升，因此 2015 年 1-2 季度市场所面临的风险是杠杆收缩带来的波动性上升。从中长期看，我们认为在新的领导层改革措施推动下，国有企业的效率提升的趋势较为确定，这是 A 股市场中长期发展的制度红利。从行业角度，我们认为，中国经济从旧的均衡（房地产及相关行业推动的经济增长）向新的均衡（居民收入增加带来的内需驱动的经济增长）转变过程中，势必会产生新的宏观经济支柱性产业，例如高端装备制造、生物医药、医疗、教育、体育文化娱乐产业、新能源等战略新兴产业，这些产业会在宏观产业政策与信贷政策的支持下不断壮大，宏观经济的占比会不断提高，这是中国经济走出“中等收入陷

阱”的保障，因此，从这些产业中寻找能够不断壮大的领先企业，是本基金的投资策略的基础。

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2014年12月31日，本基金每基金份额可供分配利润为-0.0147元，根据基金合同的约定，本报告期不进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

本基金2014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(2015)第20511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：融通领先成长股票型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2014年12月31日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2014年12月31日 | 上年度末 2013年12月31日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 35,486,111.60 | 109,157,273.10 |
| 结算备付金 | 12,346,637.59 | 4,340,563.64 |
| 存出保证金 | 659,007.76 | 364,119.98 |
| 交易性金融资产 | 1,730,418,659.45 | 2,089,846,279.58 |
| 其中：股票投资 | 1,630,260,659.45 | 1,987,476,497.08 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 100,158,000.00 | 102,369,782.50 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 5,700,128.55 | 99,800,349.70 |
| 应收证券清算款 | 16,268,902.93 | 22,923,301.63 |
| 应收利息 | 3,526,593.01 | 2,358,631.45 |
| 应收股利 | - | - |

| | | |
|-----------------|----------------------------|-----------------------------|
| 应收申购款 | 107,033.56 | 28,888.77 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 1,804,513,074.45 | 2,328,819,407.85 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2014年12月31日 | 上年度末 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 | 18,429,976.21 | 50,499,027.43 |
| 应付赎回款 | 6,698,760.19 | 1,750,738.10 |
| 应付管理人报酬 | 2,463,156.99 | 2,861,024.93 |
| 应付托管费 | 410,526.18 | 476,837.48 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 5,686,856.98 | 2,356,205.99 |
| 应交税费 | 65,649.13 | 65,649.13 |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 602,566.62 | 705,480.01 |
| 负债合计 | 34,357,492.30 | 58,714,963.07 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 944,821,872.49 | 1,204,359,620.00 |
| 未分配利润 | 825,333,709.66 | 1,065,744,824.78 |
| 所有者权益合计 | 1,770,155,582.15 | 2,270,104,444.78 |
| 负债和所有者权益总计 | 1,804,513,074.45 | 2,328,819,407.85 |

注: 报告截止日 2014 年 12 月 31 日, 基金份额净值 0.728 元, 基金份额总额 2,432,760,950.13 份。

7.2 利润表

会计主体: 融通领先成长股票型证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至 2014年12月31日 | 上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日 |
|-------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 一、收入 | 51,379,385.18 | 215,795,303.71 |
| 1. 利息收入 | 6,608,325.85 | 6,999,304.40 |
| 其中: 存款利息收入 | 1,374,218.90 | 1,333,152.38 |

| | | |
|---------------|----------------------|-----------------------|
| 债券利息收入 | 3,725,900.60 | 4,114,821.25 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 1,508,206.35 | 1,551,330.77 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2. 投资收益 | 340,011,758.25 | 132,446,805.70 |
| 其中：股票投资收益 | 319,914,105.83 | 112,085,909.14 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 262,384.47 | 169,929.46 |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 贵金属投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 19,835,267.95 | 20,190,967.10 |
| 3. 公允价值变动收益 | -295,305,354.26 | 75,937,260.84 |
| 4. 汇兑收益 | - | - |
| 5. 其他收入 | 64,655.34 | 411,932.77 |
| 减：二、费用 | 55,893,955.31 | 56,622,462.71 |
| 1. 管理人报酬 | 31,049,861.34 | 36,759,931.66 |
| 2. 托管费 | 5,174,976.83 | 6,126,655.22 |
| 3. 销售服务费 | - | - |
| 4. 交易费用 | 19,159,832.28 | 13,237,158.37 |
| 5. 利息支出 | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6. 其他费用 | 509,284.86 | 498,717.46 |
| 三、利润总额 | -4,514,570.13 | 159,172,841.00 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润 | -4,514,570.13 | 159,172,841.00 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通领先成长股票型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 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） | 1,204,359,620.00 | 1,065,744,824.78 | 2,270,104,444.78 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -4,514,570.13 | -4,514,570.13 |
| 三、本期基金份额交易产 | -259,537,747.51 | -235,896,544.99 | -495,434,292.50 |

| | | | |
|---------------------------|----------------------------------|------------------|------------------|
| 生的基金净值变动数 | | | |
| 其中：1. 基金申购款 | 7,050,590.50 | 6,352,334.35 | 13,402,924.85 |
| 2. 基金赎回款 | -266,588,338.01 | -242,248,879.34 | -508,837,217.35 |
| 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） | 944,821,872.49 | 825,333,709.66 | 1,770,155,582.15 |
| 项目 | 上年度可比期间 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） | 1,423,179,474.29 | 1,105,467,924.01 | 2,528,647,398.30 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 159,172,841.00 | 159,172,841.00 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 | -218,819,854.29 | -198,895,940.23 | -417,715,794.52 |
| 其中：1. 基金申购款 | 46,765,195.59 | 44,748,870.67 | 91,514,066.26 |
| 2. 基金赎回款 | -265,585,049.88 | -243,644,810.90 | -509,229,860.78 |
| 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） | 1,204,359,620.00 | 1,065,744,824.78 | 2,270,104,444.78 |

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：

| | | |
|------------|------------|------------|
| <u>孟朝霞</u> | <u>颜锡廉</u> | <u>刘美丽</u> |
| 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

7.4.1.1 会计政策变更的说明

财政部于 2014 年颁布《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》、《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》、《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》以及《企业会计准则第 37 号——金融

工具列报》，要求除《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》自 2014 年度财务报表起施行外，其他准则自 2014 年 7 月 1 日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.2 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、基金销售机构 |
| 中国建设银行 | 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。

7.4.4 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

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股票交易。

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

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。

7.4.4.2 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 2014 年 1 月 1 日至 | 上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 |
|----|-----------------------|----------------------------|
| | | |

| | 2014年12月31日 | 2013年12月31日 |
|-----------------|---------------|---------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 31,049,861.34 | 36,759,931.66 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 6,142,726.17 | 7,259,227.19 |

注：1、支付基金管理人融通基金管理有限公司的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 | 上年度可比期间 |
|----------------|---------------------------|---------------------------|
| | 2014年1月1日至 2014年12月31日 | 2013年1月1日至 2013年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 5,174,976.83 | 6,126,655.22 |

注：支付基金托管人中国建设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×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

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------------------|---------------------------|---------------------------|
| | 2014年1月1日至 2014年12月31日 | 2013年1月1日至 2013年12月31日 |
| 基金合同生效日（2007年4月30日）持有的基金份额 | - | - |
| 期初持有的基金份额 | 44,418,366.00 | 44,418,366.00 |
| 期间申购/买入总份额 | - | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | 44,418,366.00 | 44,418,366.00 |
| 期末持有的基金份额 占基金总份额比例 | 1.83% | 1.43% |

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

本报告期末及上年度末，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 2014年1月1日至 2014年12月31日 | | 上年度可比期间 2013年1月1日至 2013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 |
| 中国建设银行 | 35,486,111.60 | 1,270,186.86 | 109,157,273.10 | 1,224,505.01 |

注：本基金的银行存款由基金托管人 中国建设银行保管，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（2014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

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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 |
|--------|------|------------|--------|------------|-----------|------------|-----------|----------------|----------------|----|
| 300370 | 安控科技 | 2014/11/27 | 重大事项停牌 | 34.66 | 2015/2/11 | 36.00 | 2,194,730 | 78,063,430.94 | 76,069,341.80 | - |
| 600584 | 长电科技 | 2014/11/3 | 重大事项停牌 | 11.13 | 2015/1/14 | 12.24 | 5,349,931 | 61,036,952.48 | 59,544,732.03 | - |
| 合计 | | | | | | | | 139,100,383.42 | 135,614,073.83 | |

注：本基金截至2014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 | 1,630,260,659.45 | 90.34 |
| | 其中：股票 | 1,630,260,659.45 | 90.34 |
| 2 | 固定收益投资 | 100,158,000.00 | 5.55 |
| | 其中：债券 | 100,158,000.00 | 5.55 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | 5,700,128.55 | 0.32 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 47,832,749.19 | 2.65 |
| 7 | 其他各项资产 | 20,561,537.26 | 1.14 |
| 8 | 合计 | 1,804,513,074.45 | 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 | - | - |
| C | 制造业 | 925,613,056.21 | 52.29 |
| 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 | 49,048,920.90 | 2.77 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 140,552,290.02 | 7.94 |
| J | 金融业 | 300,246,404.65 | 16.96 |
| K | 房地产业 | 198,889,987.67 | 11.24 |
| L | 租赁和商务服务业 | 15,910,000.00 | 0.90 |

| | | | |
|---|---------------|------------------|-------|
| M | 科学研究和技术服务业 | | |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | | |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | | |
| P | 教育 | | |
| Q | 卫生和社会工作 | | |
| R | 文化、体育和娱乐业 | | |
| S | 综合 | | |
| | 合计 | 1,630,260,659.45 | 92.10 |

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 | 002540 | 亚太科技 | 7,532,081 | 133,920,400.18 | 7.57 |
| 2 | 002488 | 金固股份 | 5,696,995 | 132,967,863.30 | 7.51 |
| 3 | 300367 | 东方网力 | 1,501,453 | 116,813,043.40 | 6.60 |
| 4 | 002174 | 游族网络 | 1,969,307 | 95,137,221.17 | 5.37 |
| 5 | 002690 | 美亚光电 | 2,399,320 | 85,415,792.00 | 4.83 |
| 6 | 000002 | 万科A | 6,000,000 | 83,400,000.00 | 4.71 |
| 7 | 601988 | 中国银行 | 19,999,929 | 82,999,705.35 | 4.69 |
| 8 | 600036 | 招商银行 | 5,000,000 | 82,950,000.00 | 4.69 |
| 9 | 300006 | 莱美药业 | 2,687,263 | 80,268,545.81 | 4.53 |
| 10 | 300370 | 安控科技 | 2,194,730 | 76,069,341.80 | 4.30 |

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 | 600030 | 中信证券 | 248,708,360.50 | 10.96 |
| 2 | 601166 | 兴业银行 | 180,854,595.81 | 7.97 |
| 3 | 002174 | 游族网络 | 156,750,827.61 | 6.91 |
| 4 | 300367 | 东方网力 | 152,906,822.01 | 6.74 |
| 5 | 002488 | 金固股份 | 138,938,577.83 | 6.12 |
| 6 | 000002 | 万科A | 134,147,615.99 | 5.91 |
| 7 | 002540 | 亚太科技 | 129,139,107.01 | 5.69 |

| | | | | |
|----|--------|------|----------------|------|
| 8 | 002665 | 首航节能 | 126,065,006.16 | 5.55 |
| 9 | 600016 | 民生银行 | 113,009,595.18 | 4.98 |
| 10 | 600036 | 招商银行 | 112,407,221.80 | 4.95 |
| 11 | 600270 | 外运发展 | 103,328,408.42 | 4.55 |
| 12 | 300006 | 莱美药业 | 98,907,334.96 | 4.36 |
| 13 | 002690 | 美亚光电 | 97,344,363.54 | 4.29 |
| 14 | 600690 | 青岛海尔 | 95,873,527.31 | 4.22 |
| 15 | 000776 | 广发证券 | 94,905,506.07 | 4.18 |
| 16 | 600837 | 海通证券 | 90,238,860.75 | 3.98 |
| 17 | 300369 | 绿盟科技 | 88,048,077.70 | 3.88 |
| 18 | 300254 | 仟源医药 | 86,521,044.71 | 3.81 |
| 19 | 300370 | 安控科技 | 78,063,430.94 | 3.44 |
| 20 | 601988 | 中国银行 | 77,917,684.67 | 3.43 |
| 21 | 002008 | 大族激光 | 75,262,846.57 | 3.32 |
| 22 | 002363 | 隆基机械 | 72,211,800.53 | 3.18 |
| 23 | 600000 | 浦发银行 | 67,977,842.99 | 2.99 |
| 24 | 601998 | 中信银行 | 67,843,403.87 | 2.99 |
| 25 | 300379 | 东方通 | 62,261,017.19 | 2.74 |
| 26 | 600584 | 长电科技 | 61,036,952.48 | 2.69 |
| 27 | 300378 | 鼎捷软件 | 60,680,137.58 | 2.67 |
| 28 | 002156 | 通富微电 | 59,226,263.87 | 2.61 |
| 29 | 600594 | 益佰制药 | 59,171,616.51 | 2.61 |
| 30 | 000793 | 华闻传媒 | 58,841,097.19 | 2.59 |
| 31 | 000402 | 金融街 | 58,360,774.26 | 2.57 |
| 32 | 601989 | 中国重工 | 58,257,413.87 | 2.57 |
| 33 | 300133 | 华策影视 | 56,367,180.04 | 2.48 |
| 34 | 000718 | 苏宁环球 | 55,025,350.37 | 2.42 |
| 35 | 000656 | 金科股份 | 54,147,199.11 | 2.39 |
| 36 | 002243 | 通产丽星 | 53,551,188.36 | 2.36 |
| 37 | 601628 | 中国人寿 | 53,374,898.21 | 2.35 |
| 38 | 600660 | 福耀玻璃 | 51,914,696.91 | 2.29 |
| 39 | 300392 | 腾信股份 | 50,340,819.73 | 2.22 |
| 40 | 600535 | 天士力 | 49,740,109.35 | 2.19 |
| 41 | 002683 | 宏大爆破 | 48,710,304.41 | 2.15 |
| 42 | 300337 | 银邦股份 | 46,281,258.04 | 2.04 |
| 43 | 300346 | 南大光电 | 46,053,066.35 | 2.03 |

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 | 600030 | 中信证券 | 301,916,422.43 | 13.30 |
| 2 | 300124 | 汇川技术 | 144,947,305.15 | 6.39 |
| 3 | 601166 | 兴业银行 | 134,470,448.55 | 5.92 |
| 4 | 600016 | 民生银行 | 121,193,981.19 | 5.34 |
| 5 | 600837 | 海通证券 | 107,578,798.69 | 4.74 |
| 6 | 300017 | 网宿科技 | 107,013,380.27 | 4.71 |
| 7 | 600690 | 青岛海尔 | 91,751,055.03 | 4.04 |
| 8 | 000776 | 广发证券 | 90,865,783.43 | 4.00 |
| 9 | 002008 | 大族激光 | 86,561,982.80 | 3.81 |
| 10 | 000002 | 万科A | 82,525,085.98 | 3.64 |
| 11 | 600872 | 中炬高新 | 81,872,103.73 | 3.61 |
| 12 | 300254 | 仟源医药 | 81,288,165.35 | 3.58 |
| 13 | 002665 | 首航节能 | 77,147,243.78 | 3.40 |
| 14 | 300145 | 南方泵业 | 75,476,274.10 | 3.32 |
| 15 | 002475 | 立讯精密 | 73,371,447.22 | 3.23 |
| 16 | 002410 | 广联达 | 70,419,782.82 | 3.10 |
| 17 | 000400 | 许继电气 | 68,599,641.72 | 3.02 |
| 18 | 600999 | 招商证券 | 67,509,318.11 | 2.97 |
| 19 | 600000 | 浦发银行 | 67,039,976.33 | 2.95 |
| 20 | 601998 | 中信银行 | 65,808,835.29 | 2.90 |
| 21 | 601989 | 中国重工 | 65,626,813.45 | 2.89 |
| 22 | 600660 | 福耀玻璃 | 63,587,948.81 | 2.80 |
| 23 | 600535 | 天士力 | 63,384,175.36 | 2.79 |
| 24 | 300392 | 腾信股份 | 60,662,410.33 | 2.67 |
| 25 | 600633 | 浙报传媒 | 60,124,013.61 | 2.65 |
| 26 | 000024 | 招商地产 | 59,572,077.78 | 2.62 |
| 27 | 000656 | 金科股份 | 59,108,234.50 | 2.60 |
| 28 | 000793 | 华闻传媒 | 57,851,504.91 | 2.55 |
| 29 | 002156 | 通富微电 | 57,485,122.08 | 2.53 |
| 30 | 002385 | 大北农 | 57,069,255.64 | 2.51 |
| 31 | 600270 | 外运发展 | 54,722,839.32 | 2.41 |
| 32 | 600594 | 益佰制药 | 53,783,460.16 | 2.37 |
| 33 | 002236 | 大华股份 | 52,396,220.38 | 2.31 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 34 | 002683 | 宏大爆破 | 51,171,788.14 | 2.25 |
| 35 | 600585 | 海螺水泥 | 50,523,822.43 | 2.23 |
| 36 | 002243 | 通产丽星 | 50,248,517.49 | 2.21 |
| 37 | 601633 | 长城汽车 | 49,627,472.70 | 2.19 |
| 38 | 300133 | 华策影视 | 49,387,812.97 | 2.18 |
| 39 | 601318 | 中国平安 | 49,130,634.36 | 2.16 |
| 40 | 000895 | 双汇发展 | 48,675,371.28 | 2.14 |
| 41 | 000538 | 云南白药 | 47,020,216.07 | 2.07 |
| 42 | 002174 | 游族网络 | 45,485,888.54 | 2.00 |

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 | 6,102,652,838.84 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 6,484,129,803.96 |

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 | 100,158,000.00 | 5.66 |
| | 其中：政策性金融债 | 100,158,000.00 | 5.66 |
| 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 | 100,158,000.00 | 5.66 |

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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 | 140430 | 14 农发 30 | 700,000 | 70,119,000.00 | 3.96 |
| 2 | 140320 | 14 进出 20 增 | 300,000 | 30,039,000.00 | 1.70 |

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.10.1 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。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券中无发行主体本期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。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 659,007.76 |
| 2 | 应收证券清算款 | 16,268,902.93 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,526,593.01 |

| | | |
|---|-------|---------------|
| 5 | 应收申购款 | 107,033.56 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 20,561,537.26 |

8.12.4 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。

8.12.5 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

| 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 |
| 142,803 | 17,035.78 | 54,036,805.30 | 2.22% | 2,378,724,144.83 | 97.78% |

9.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额 (份) | 占上市总份额比例 |
|----|------------|---------------|----------|
| 1 | 融通基金管理有限公司 | 44,418,366.00 | 23.55% |
| 2 | 天津证券登记公司 | 5,599,032.00 | 2.97% |
| 3 | 吴颂今 | 2,724,973.00 | 1.45% |
| 4 | 叶风 | 1,850,000.00 | 0.98% |
| 5 | 王金明 | 1,807,900.00 | 0.96% |
| 6 | 魏曙光 | 1,539,219.00 | 0.82% |
| 7 | 汪若清 | 1,227,268.00 | 0.65% |
| 8 | 魏宏 | 1,207,482.00 | 0.64% |
| 9 | 许玉明 | 1,068,572.00 | 0.57% |
| 10 | 马淑玲 | 707,123.00 | 0.37% |

注：持有人为场内持有人。

9.3 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 | 32,370.13 | 0.00133% |

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|--------------------------------|--------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金 | 0 |

| | |
|-----------------|---|
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |
|-----------------|---|

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2007 年 4 月 30 日）基金份额总额 | 500,000,000.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 3,100,984,958.42 |
| 本报告期基金总申购份额 | 18,153,757.06 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 686,377,765.35 |
| 本报告期末基金份额总额 | 2,432,760,950.13 |

§ 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

1、经公司董事会审议并经中国证监会核准，孟朝霞女士担任公司总经理职务，奚星华先生不再担任公司总经理职务。

具体内容请参阅 2014 年 9 月 25 日在《证券时报》上刊登的相关公告。

2、经公司董事会审议通过并报中国证券投资基金业协会和中国证券监督管理委员会深圳监管局备案，秦玮先生不再担任公司副总经理职务。

具体内容请参阅 2014 年 12 月 31 日在《证券时报》上刊登的相关公告。

11.2.2 基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本基金的基金托管人中国建设银行股份有限公司 2014 年 2 月 7 日发布任免通知，解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。2014 年 11 月 3 日发布公告，聘任赵观甫为中国建设银行投资托管业务部总经理。

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 2011 年 10 月 20 日以来为本基金提供审计服务至今。本基金本报告期本年度应支付的审计费用为人民

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 | |
| 国泰君安 | 1 | 2,485,190,569.06 | 19.79% | 2,199,188.32 | 19.58% | - |
| 齐鲁证券 | 1 | 1,986,532,865.81 | 15.82% | 1,808,541.03 | 16.10% | - |
| 国信证券 | 1 | 1,915,817,010.10 | 15.25% | 1,695,369.91 | 15.09% | - |
| 中银国际 | 1 | 1,876,012,188.34 | 14.94% | 1,660,100.21 | 14.78% | - |
| 国金证券 | 1 | 1,715,836,576.82 | 13.66% | 1,518,362.80 | 13.52% | - |
| 宏源证券 | 1 | 1,023,374,455.63 | 8.15% | 931,676.72 | 8.30% | - |
| 申银万国 | 1 | 829,230,931.63 | 6.60% | 754,931.36 | 6.72% | - |
| 华泰证券 | 1 | 413,818,734.34 | 3.29% | 376,741.09 | 3.35% | - |
| 中金公司 | 1 | 314,650,025.28 | 2.51% | 286,459.18 | 2.55% | - |
| 高华证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 新时代证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | 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

本报告期内本基金新增上海证券交易单元一个，终止国元证券交易单元一个。

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 |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 齐鲁证券 | 2,918,674.20 | 100.00% | 3,240,000,000.00 | 70.28% | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 宏源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申银万国 | - | - | 910,000,000.00 | 19.74% | - | - |
| 华泰证券 | - | - | 80,000,000.00 | 1.74% | - | - |
| 中金公司 | - | - | 380,000,000.00 | 8.24% | - | - |
| 高华证券 | - | - | - | - | - | - |
| 新时代证券 | - | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | - | - | - | - | - | - |

融通基金管理有限公司

二〇一五年三月二十六日