

# 融通动力先锋股票型证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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 2015 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 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	1,649,056,108.88 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 7 月 1 日起：沪深 300 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20% 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%；
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	蒋松云
	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	2014 年	2013 年	2012 年
---------------	--------	--------	--------

本期已实现收益	777,440,434.91	302,976,476.45	-203,005,637.73
本期利润	755,474,624.82	379,045,825.92	47,341,377.56
加权平均基金份额本期利润	0.4751	0.2012	0.0246
本期基金份额净值增长率	44.31%	21.36%	2.62%
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	0.3527	-0.1632	-0.3243
期末基金资产净值	2,717,853,279.81	2,183,717,533.17	1,752,361,795.59
期末基金份额净值	1.648	1.142	0.941

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）。

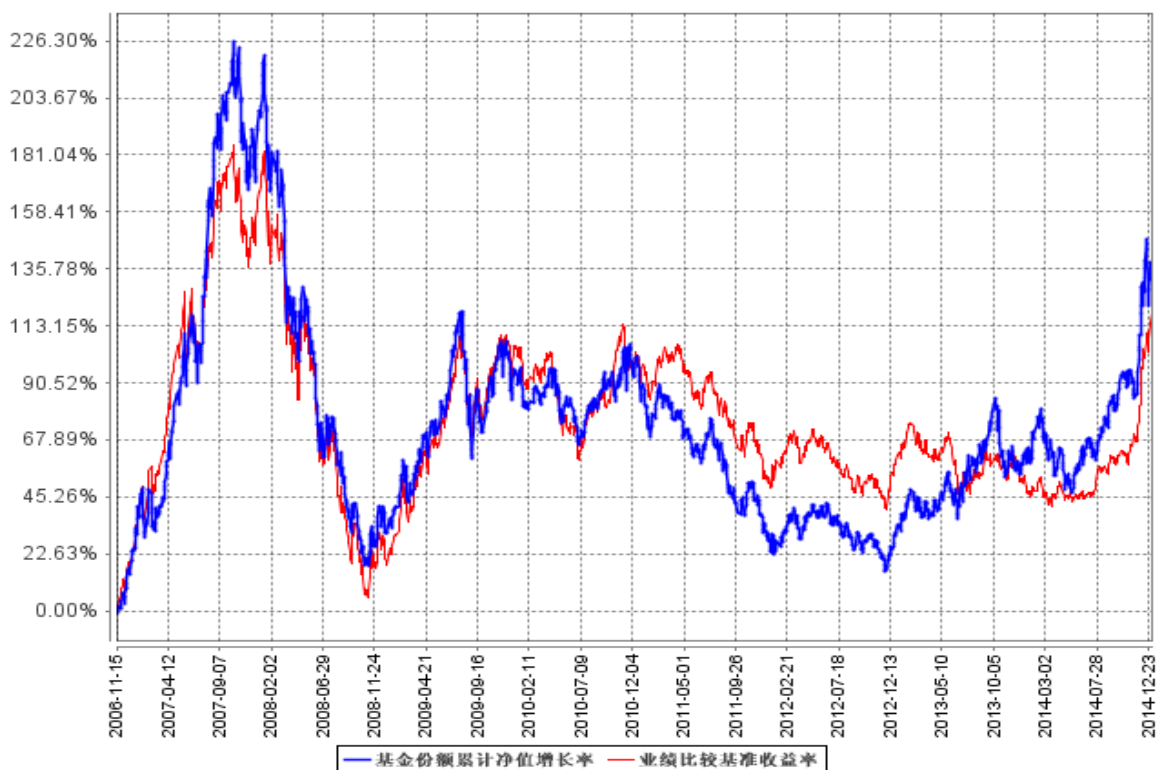
### 3.2 基金净值表现

#### 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	22.99%	1.77%	34.64%	1.32%	-11.65%	0.45%
过去六个月	40.37%	1.42%	48.95%	1.06%	-8.58%	0.36%
过去一年	44.31%	1.40%	41.73%	0.97%	2.58%	0.43%
过去三年	79.72%	1.38%	42.62%	1.04%	37.10%	0.34%
过去五年	19.63%	1.32%	6.21%	1.09%	13.42%	0.23%
自基金合同生效起至今	134.52%	1.65%	118.17%	1.50%	16.35%	0.15%

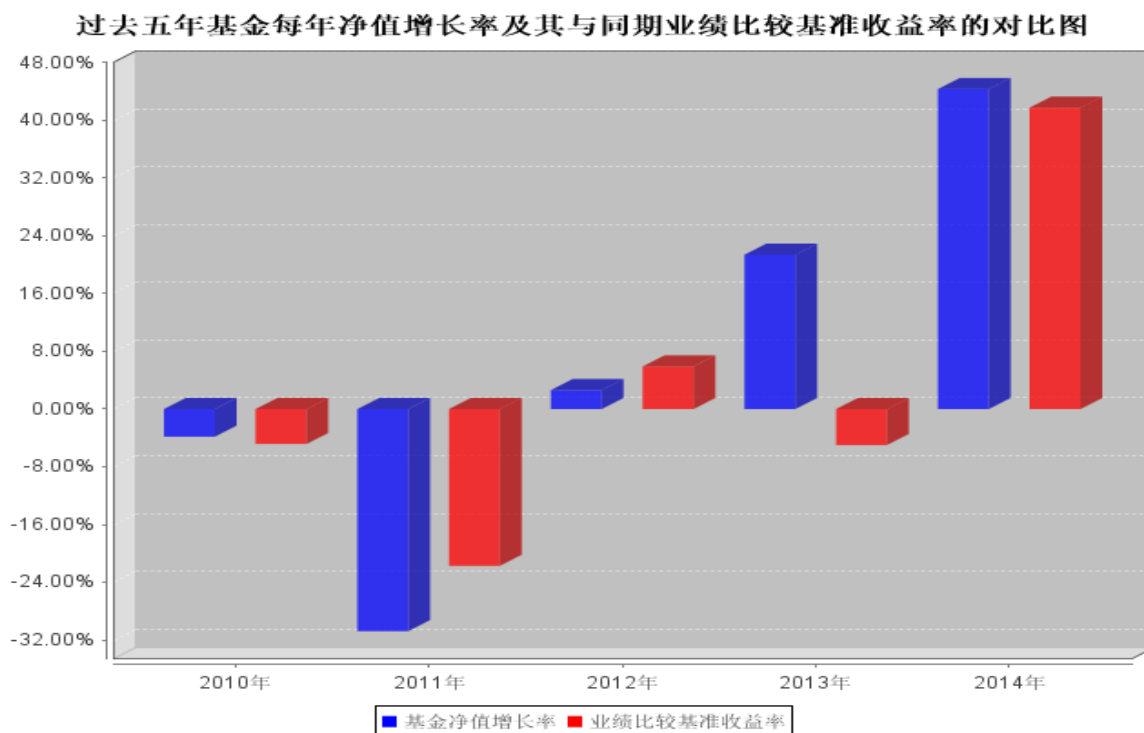
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



## 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
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金字[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		
丁经纬	本基金基金经理，融通通泽灵活配置混合基金基金经理	2014年8月21日	-	6	工学硕士，具有基金从业资格。2003年3月至2008年6月在浙江国华浙能发电有限公司工作，任技术主管；2008年7月至2009年7月在元大证券（香港）有限公司上海代表处工作，任行业分析师；2009年8月至2011年5月在新华基金管理有限公司工作，任行业分析师。2011年5月加入融通基金管理公司，历任投资经理助理、投资经理。
郭恒	本基金的基金经理	2011年3月24日	2014年9月2日	18	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公司。

注：任职日期和离任日期均指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和本基金合同的规定，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年的A股市场大致可分为上下两个半场，上半场主角为创业板，下半场主角为主板。市场经历了创业板一季度的疯狂，第二季度的系统性下跌，第三季度的蓝筹逆袭，并最终在四季度顺利实现了持续两年多的创业板单边牛市向主板的全面牛市的扩散。报告期内，本基金基本跟上了市场运行的主线，并取得了全年44.31%较为不错的收益率。

在本年报中，我们重点讨论一下两方面内容：一是本轮牛市的逻辑是什么，二是新的一年我



们的重点投资方向在哪里。

回过头看，其实从2012年12月4号起，在创业板综指创下585点的历史低点之后，A股市场已经开始了摆脱熊市的艰难之旅，就过去两年多的走势而言，无论是将镜头拉长至2012年底，还是将镜头缩短至2014年7月份，我们发现，行情的主线都是转型，2012年底以来的创业板单边牛市是科技创新的转型逻辑，而2014年7月份以来的蓝筹逆袭，无论是8月份的国企改革主题、9月份的军工主题、10月份的沪港通主题，直至11月以大金融和大基建为代表的大蓝筹全面爆发式上涨，都是遵循改革的逻辑，改革是对不合理制度的改良，正是经济转型的应有之意，因此，无论是国企蓝筹的上涨，还是创业板的上涨，改革的逻辑和科技创新的逻辑都是转型的逻辑，本质上是一样的，区别在于改革只是一次性的政策红利，而科技的创新却是人类社会永恒的需求。

#### 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 44.31%，同期业绩比较基准收益率为 41.73%。

#### 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 2015 年，开年头两个月的走势告诉我们市场并非如大家之前预期的一马平川走势，而是采取创业板逆袭的方式开篇，这显示出大盘在经历了 2014 年底的一波快速拉升之后，需要充分的时间来消化获利筹码，但牛市集结号已经吹响，股市的赚钱效应仍在继续扩散，因此，我们判断大盘向下调整的空间非常有限，久盘之后可能呈现震荡向上的走势。但在具体的板块轮动和节奏上，市场会比想象中更为复杂，但不管向哪个主题或者板块轮动，如果我们认可本轮牛市的逻辑是转型的逻辑，那么，对于 2015 年的投资方向，就会显得简单而清晰，改革的主线就是金融改革、国企改革、以及财税改革三个方向，而就科技创新而言，我们切身感受最为明显的就是移动互联网。

当然，我们也需要防范风险，过去一年，满仓踏空，牛市亏钱的案例比比皆是。我们发现，自 2014 年底以来，行情从大金融大基建板块向两个方向扩散，一个是向地产、煤炭、有色等传统周期板块扩散，另一个是向传媒互联网为代表的新兴产业扩散，对于后者，由于上涨逻辑的本质是一样的，我们认为属于正常的主题轮动，合情合理，而对于前者，即改革的逻辑向周期逻辑进行扩散的现象，我们需要密切观察其持续性，如果持续时间过长，相关板块的上涨空间过大，我们则要防范行情性质变化导致的市场大幅调整风险。

#### 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

本基金本报告期暂不进行利润分配，符合基金合同约定。

### § 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2014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 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 20510 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：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
<b>资 产：</b>		
银行存款	38,519,808.57	80,197,375.67
结算备付金	16,289,930.80	16,310,509.28
存出保证金	1,519,420.94	2,250,541.10
交易性金融资产	2,674,198,785.69	2,115,968,418.98
其中：股票投资	2,571,446,381.49	2,014,293,309.58
基金投资	-	-
债券投资	102,752,404.20	101,675,109.40
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	-	49,958,224.98
应收证券清算款	-	-
应收利息	2,684,403.11	914,555.42
应收股利	-	-
应收申购款	11,578,545.21	126,222.24
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-

资产总计	2,744,790,894.32	2,265,725,847.67
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2014年12月31日</b>	<b>2013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	-	66,771,282.62
应付赎回款	10,625,111.01	2,683,130.04
应付管理人报酬	3,303,364.82	2,870,659.12
应付托管费	550,560.81	478,443.20
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	11,599,979.11	8,000,014.30
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	858,598.76	1,204,785.22
负债合计	26,937,614.51	82,008,314.50
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	1,649,056,108.88	1,912,960,238.06
未分配利润	1,068,797,170.93	270,757,295.11
所有者权益合计	2,717,853,279.81	2,183,717,533.17
负债和所有者权益总计	2,744,790,894.32	2,265,725,847.67

注:报告截止日 2014 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.648 元,基金份额总额 1,649,056,108.88 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:2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

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
<b>一、收入</b>	824,457,665.58	448,186,650.65
1. 利息收入	5,445,261.79	5,208,172.08
其中:存款利息收入	1,393,797.03	1,615,957.69
债券利息收入	3,847,825.03	3,335,448.44
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	203,639.73	256,765.95

其他利息收入	-	-
2. 投资收益	840,507,929.95	366,557,431.85
其中：股票投资收益	830,575,592.87	354,873,655.71
基金投资收益	-	-
债券投资收益	473,509.58	375,972.39
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	9,458,827.50	11,307,803.75
3. 公允价值变动收益	-21,965,810.09	76,069,349.47
4. 汇兑收益	-	-
5. 其他收入	470,283.93	351,697.25
<b>减：二、费用</b>	<b>68,983,040.76</b>	<b>69,140,824.73</b>
1. 管理人报酬	29,418,183.43	30,254,773.94
2. 托管费	4,903,030.59	5,042,462.28
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	34,077,237.34	33,419,014.55
5. 利息支出	68,881.66	-
其中：卖出回购金融资产支出	68,881.66	-
6. 其他费用	515,707.74	424,573.96
<b>三、利润总额</b>	<b>755,474,624.82</b>	<b>379,045,825.92</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润</b>	<b>755,474,624.82</b>	<b>379,045,825.92</b>

### 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：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）	1,912,960,238.06	270,757,295.11	2,183,717,533.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	755,474,624.82	755,474,624.82
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-263,904,129.18	42,565,251.00	-221,338,878.18
其中：1. 基金申购款	421,595,280.02	216,770,373.79	638,365,653.81
2. 基金赎回款	-685,499,409.20	-174,205,122.79	-859,704,531.99

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）	1,649,056,108.88	1,068,797,170.93	2,717,853,279.81
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）	1,861,322,722.64	-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

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：

孟朝霞

颜锡廉

刘美丽

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一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

本基金本报告期内无会计估计变更，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 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	
	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	3,865,509,292.86	17.28%	1,533,367,261.47	6.93%

##### 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 2014年1月1日至2014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	3,519,154.98	17.50%	2,034,476.97	17.54%
关联方名称	上年度可比期间 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%

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 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
	当期发生的基金应支付的管理费	29,418,183.43
其中：支付销售机构的客户维护费	5,011,038.93	5,172,492.91

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：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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 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



	月 31 日	日
当期发生的基金应支付的托管费	4,903,030.59	5,042,462.28

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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

#### 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自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自有资金投资本基金。

##### 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
中国工商银行	38,519,808.57	1,165,168.43	80,197,375.67	1,332,309.10

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（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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

##### 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
300347	泰格医药	2014-12-10	筹划非公开发行	30.22	2015-1-22	33.24	399,880	13,131,740.41	12,084,373.60	

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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,571,446,381.49	93.68
	其中：股票	2,571,446,381.49	93.68
2	固定收益投资	102,752,404.20	3.74
	其中：债券	102,752,404.20	3.74
	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	-	-
	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	54,809,739.37	2.00
7	其他各项资产	15,782,369.26	0.57
8	合计	2,744,790,894.32	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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,938,000.00	0.11
C	制造业	487,411,934.97	17.93
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	335,086,488.10	12.33
J	金融业	1,569,386,057.49	57.74
K	房地产业	164,539,527.33	6.05
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	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	12,084,373.60	0.44
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,571,446,381.49	94.61

## 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	600030	中信证券	7,000,000	237,300,000.00	8.73
2	600837	海通证券	9,599,792	230,970,995.52	8.50
3	600577	精达股份	31,673,686	224,566,433.74	8.26
4	600016	民生银行	16,999,819	184,958,030.72	6.81
5	002657	中科金财	3,507,246	166,559,112.54	6.13

6	000547	闽福发 A	11,911,502	159,852,356.84	5.88
7	600570	恒生电子	2,799,857	153,320,169.32	5.64
8	000712	锦龙股份	5,109,805	138,986,696.00	5.11
9	600999	招商证券	4,499,985	127,214,575.95	4.68
10	601555	东吴证券	3,999,905	89,677,870.10	3.30

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	600837	海通证券	374,277,668.25	17.14
2	600030	中信证券	354,379,909.98	16.23
3	600016	民生银行	274,941,671.64	12.59
4	000712	锦龙股份	254,776,980.23	11.67
5	600577	精达股份	214,306,977.90	9.81
6	600999	招商证券	200,103,093.69	9.16
7	002657	中金金财	187,131,497.88	8.57
8	600570	恒生电子	182,347,263.58	8.35
9	002385	大北农	170,771,564.32	7.82
10	601788	光大证券	167,792,478.17	7.68
11	600812	华北制药	165,843,315.32	7.59
12	600728	佳都科技	161,535,989.18	7.40
13	600587	新华医疗	149,334,461.57	6.84
14	600028	中国石化	145,885,341.46	6.68
15	600060	海信电器	137,494,962.68	6.30
16	000547	闽福发 A	135,925,117.02	6.22
17	002410	广联达	132,799,264.03	6.08
18	600015	华夏银行	127,215,806.16	5.83
19	601888	中国国旅	125,867,215.20	5.76
20	000783	长江证券	125,563,888.20	5.75
21	601328	交通银行	125,500,409.80	5.75
22	601988	中国银行	122,768,573.26	5.62

23	601800	中国交建	117,057,707.04	5.36
24	002594	比亚迪	114,124,341.63	5.23
25	601555	东吴证券	110,859,609.71	5.08
26	000776	广发证券	107,578,044.39	4.93
27	002219	恒康医疗	104,584,584.68	4.79
28	600862	南通科技	96,416,436.72	4.42
29	600525	长园集团	96,411,885.94	4.42
30	601288	农业银行	93,235,443.93	4.27
31	000801	四川九洲	93,127,094.59	4.26
32	601390	中国中铁	92,372,367.16	4.23
33	600000	浦发银行	91,532,418.83	4.19
34	600594	益佰制药	90,621,002.12	4.15
35	300133	华策影视	88,460,386.52	4.05
36	601688	华泰证券	87,836,496.85	4.02
37	600536	中国软件	84,093,391.56	3.85
38	601336	新华保险	83,813,147.74	3.84
39	000541	佛山照明	83,282,305.80	3.81
40	600315	上海家化	81,116,882.19	3.71
41	300059	东方财富	79,669,944.42	3.65
42	002683	宏大爆破	78,051,136.40	3.57
43	600109	国金证券	76,861,929.79	3.52
44	601333	广深铁路	75,469,472.72	3.46
45	601989	中国重工	73,956,390.60	3.39
46	300024	机器人	73,682,505.14	3.37
47	601166	兴业银行	73,015,269.36	3.34
48	300006	莱美药业	72,349,659.97	3.31
49	600527	江南高纤	71,538,721.04	3.28
50	000666	经纬纺机	70,783,088.68	3.24
51	600848	自仪股份	69,857,671.02	3.20
52	300011	鼎汉技术	69,450,489.44	3.18
53	601998	中信银行	69,029,234.52	3.16
54	600418	江淮汽车	69,021,165.00	3.16
55	300298	三诺生物	68,695,022.28	3.15
56	002368	太极股份	67,189,477.00	3.08
57	300251	光线传媒	66,240,385.10	3.03
58	600196	复星医药	64,979,322.66	2.98

59	601901	方正证券	64,779,416.01	2.97
60	300291	华录百纳	63,902,323.25	2.93
61	002051	中工国际	61,625,485.74	2.82
62	002465	海格通信	59,931,396.12	2.74
63	000001	平安银行	57,721,310.95	2.64
64	300370	安控科技	56,261,375.23	2.58
65	000996	中国中期	55,381,088.30	2.54
66	000612	焦作万方	54,754,165.00	2.51
67	600036	招商银行	54,317,737.50	2.49
68	601006	大秦铁路	53,852,051.97	2.47
69	002714	牧原股份	51,729,612.41	2.37
70	002407	多氟多	51,132,093.39	2.34
71	300104	乐视网	51,071,841.63	2.34
72	002023	海特高新	50,841,711.34	2.33
73	600161	天坛生物	50,380,864.29	2.31
74	601866	中海集运	49,024,805.43	2.25
75	600195	中牧股份	48,921,008.66	2.24
76	601633	长城汽车	48,790,719.63	2.23
77	600887	伊利股份	48,547,262.19	2.22
78	600266	北京城建	48,431,671.75	2.22
79	000518	四环生物	48,326,691.96	2.21
80	002183	怡亚通	48,070,937.21	2.20
81	600369	西南证券	47,916,670.90	2.19
82	600588	用友软件	47,743,152.96	2.19
83	600031	三一重工	47,726,958.32	2.19
84	002511	中顺洁柔	46,887,681.51	2.15
85	300165	天瑞仪器	46,128,079.77	2.11
86	600708	海博股份	45,082,619.37	2.06
87	300228	富瑞特装	45,017,434.63	2.06
88	002664	信质电机	44,154,154.19	2.02
89	000078	海王生物	43,947,829.18	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	600837	海通证券	253,922,249.04	11.63
2	600587	新华医疗	235,756,269.51	10.80
3	600570	恒生电子	228,531,487.69	10.47
4	600030	中信证券	221,639,172.06	10.15
5	600525	长园集团	178,124,336.43	8.16
6	600527	江南高纤	170,119,158.59	7.79
7	002683	宏大爆破	169,152,362.97	7.75
8	002385	大北农	168,529,060.36	7.72
9	600812	华北制药	161,954,998.08	7.42
10	600015	华夏银行	147,137,039.44	6.74
11	601328	交通银行	146,454,618.86	6.71
12	300133	华策影视	144,604,531.88	6.62
13	300164	通源石油	142,065,993.70	6.51
14	002368	太极股份	141,996,736.57	6.50
15	600028	中国石化	137,215,594.15	6.28
16	601988	中国银行	136,428,847.84	6.25
17	002410	广联达	135,064,667.18	6.19
18	600594	益佰制药	134,196,160.82	6.15
19	600728	佳都科技	132,603,512.96	6.07
20	600060	海信电器	129,994,852.05	5.95
21	601800	中国交建	126,853,124.38	5.81
22	000712	锦龙股份	123,641,801.94	5.66
23	601888	中国国旅	121,576,580.83	5.57
24	300104	乐视网	119,053,003.16	5.45
25	002465	海格通信	118,026,304.61	5.40
26	300070	碧水源	112,051,226.95	5.13
27	002594	比亚迪	110,598,706.89	5.06
28	601788	光大证券	109,462,386.42	5.01
29	600000	浦发银行	108,968,607.12	4.99
30	300011	鼎汉技术	107,780,461.37	4.94
31	600016	民生银行	106,245,154.18	4.87
32	300300	汉鼎股份	105,823,402.16	4.85
33	000541	佛山照明	105,112,988.55	4.81
34	601390	中国中铁	103,011,117.22	4.72
35	000801	四川九洲	100,190,709.15	4.59
36	600887	伊利股份	97,928,733.00	4.48

37	002567	唐人神	97,790,646.09	4.48
38	601288	农业银行	96,864,541.34	4.44
39	300145	南方泵业	93,130,740.25	4.26
40	300059	东方财富	92,005,216.60	4.21
41	600536	中国软件	88,949,591.53	4.07
42	002219	恒康医疗	88,811,029.27	4.07
43	600999	招商证券	85,799,597.57	3.93
44	002664	信质电机	84,824,336.72	3.88
45	601998	中信银行	80,897,550.75	3.70
46	601333	广深铁路	79,682,953.75	3.65
47	600315	上海家化	79,313,411.59	3.63
48	601901	方正证券	78,936,000.00	3.61
49	000661	长春高新	78,287,039.68	3.59
50	601633	长城汽车	77,796,221.06	3.56
51	601989	中国重工	76,492,487.24	3.50
52	002501	利源精制	75,304,133.98	3.45
53	300024	机器人	74,384,532.86	3.41
54	601166	兴业银行	72,769,086.27	3.33
55	300006	莱美药业	72,293,909.55	3.31
56	300291	华录百纳	72,267,118.94	3.31
57	600848	自仪股份	69,647,493.72	3.19
58	600109	国金证券	68,313,017.34	3.13
59	000776	广发证券	68,239,836.20	3.12
60	600418	江淮汽车	67,999,327.92	3.11
61	600196	复星医药	67,498,238.24	3.09
62	002714	牧原股份	66,206,614.96	3.03
63	600637	百视通	66,082,787.71	3.03
64	002051	中工国际	65,504,959.82	3.00
65	000783	长江证券	63,251,014.00	2.90
66	300298	三诺生物	62,940,641.15	2.88
67	300055	万邦达	60,648,813.87	2.78
68	300251	光线传媒	58,615,723.42	2.68
69	300370	安控科技	57,469,906.29	2.63
70	600161	天坛生物	56,257,486.95	2.58
71	002005	德豪润达	56,138,196.21	2.57
72	000996	中国中期	56,019,559.76	2.57
73	000612	焦作万方	54,535,663.60	2.50
74	601006	大秦铁路	53,679,814.84	2.46



75	600031	三一重工	53,012,421.45	2.43
76	600266	北京城建	52,638,441.39	2.41
77	002407	多氟多	50,876,871.66	2.33
78	601866	中海集运	50,305,680.70	2.30
79	002183	怡亚通	50,073,517.59	2.29
80	600195	中牧股份	49,376,253.73	2.26
81	002023	海特高新	49,030,923.00	2.25
82	300045	华力创通	48,959,054.58	2.24
83	002511	中顺洁柔	48,559,188.36	2.22
84	601818	光大银行	48,540,856.64	2.22
85	000518	四环生物	47,340,422.54	2.17
86	601186	中国铁建	46,374,290.54	2.12
87	002117	东港股份	46,264,858.68	2.12
88	601766	中国南车	45,887,650.16	2.10
89	600118	中国卫星	44,856,869.80	2.05
90	300228	富瑞特装	44,164,521.09	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	11,078,119,054.96
卖出股票收入（成交）总额	11,329,211,110.61

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	100,045,000.00	3.68
	其中：政策性金融债	100,045,000.00	3.68
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,707,404.20	0.10
8	其他	-	-
9	合计	102,752,404.20	3.78

**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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	140213	14 国开 13	700,000	70,000,000.00	2.58
2	140207	14 国开 07	300,000	30,045,000.00	1.11
3	110022	同仁转债	19,010	2,707,404.20	0.10

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 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、2014 年 5 月 26 日，东吴证券公告称公司收到中国证券监督管理委员会《关于对东吴证券股份有限公司采取出具警示函监管措施的决定》（[2014]17 号）（以下简称“决定”），因公司在承销上海良信电器项目过程中，资本市场部的杨庆林、池梁在询价敏感时间段与某个人投资者电话联系，该投资者实际控制的投资产品参与报价并获得配售。根据《证券公司监督管理条例》、《证券发行与承销管理办法》的有关规定，中国证监会对公司采取出具警示函的监管措施。

收到上述《决定》后，公司高度重视，并将进一步加强内部管理，严肃问责，完善相关工作程序，有效防范风险。

2、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。

### 8.12.2 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（元）
1	存出保证金	1,519,420.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,684,403.11
5	应收申购款	11,578,545.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,782,369.26

### 8.12.4 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	2,707,404.20	0.10

## 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

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
81,163	20,317.83	327,413,000.82	19.85%	1,321,643,108.06	80.15%

## 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	2,672,446.12	0.1621%

## 9.3 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（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	1,912,960,238.06
本报告期基金总申购份额	421,595,280.02
减：本报告期基金总赎回份额	685,499,409.20
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,649,056,108.88

## § 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。

3、2014 年 8 月 21 日，本基金管理人发布公告，增聘丁经纬为本基金基金经理，具体内容请参阅 2014 年 8 月 21 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》上刊登的相关公告。

4、2014 年 9 月 2 日，本基金管理人发布公告，郭恒不再担任本基金基金经理，具体内容请参阅 2014 年 9 月 2 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》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

本报告期内，因中国工商银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

### 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	6,449,260,487.39	28.82%	5,706,956.88	28.37%	-
新时代证券	1	3,865,509,292.86	17.28%	3,519,154.98	17.50%	-
中信建投	1	2,853,320,080.54	12.75%	2,597,662.22	12.92%	-
申银万国	1	2,197,003,127.87	9.82%	2,000,130.64	9.94%	-
光大证券	1	1,845,757,130.33	8.25%	1,633,313.39	8.12%	-
安信证券	1	1,773,173,952.50	7.92%	1,614,290.73	8.03%	-
恒泰证券	1	868,643,896.27	3.88%	790,804.01	3.93%	-
国泰君安	1	692,015,305.37	3.09%	612,364.94	3.04%	-
招商证券	1	594,452,713.75	2.66%	526,031.83	2.62%	-
中信证券	1	495,868,805.80	2.22%	438,793.95	2.18%	-
广州证券	2	316,996,317.23	1.42%	288,594.70	1.43%	-
平安证券	1	230,286,770.74	1.03%	209,651.81	1.04%	-
渤海证券	2	142,271,635.77	0.64%	129,523.28	0.64%	-
中航证券	1	50,486,007.80	0.23%	45,962.30	0.23%	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
中山证券	2	-	-	-	-	-
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) 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

本报告期内，终止租用中投证券交易单元 2 个、广州证券交易单元 1 个、长江证券交易单元 2  
个、中山证券交易单元 1 个、中航证券 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	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	600,000,000.00	100.00%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

中信证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-

融通基金管理有限公司

二〇一五年三月二十六日