

融通通利系列证券投资基金之  
融通深证 100 指数证券投资基金 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

融通通利系列证券投资基金由融通债券投资基金、融通深证 100 指数证券投资基金和融通蓝筹成长证券投资基金共同构成。本年度报告为融通通利系列证券投资基金之子基金融通债券投资基金（以下简称“本基金”）2014 年年度报告。

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《融通通利系列证券投资基金基金合同》的规定，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	融通深证 100 指数
基金主代码	161604
前端交易代码	161604
后端交易代码	161654
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 9 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	10,295,056,352.40 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	运用指数化投资方式，通过控制股票投资组合与深证 100 指数的跟踪误差，力求实现对深证 100 指数的有效跟踪，谋求分享中国经济的持续、稳定增长和中国证券市场的发展，实现基金资产的长期增长，为投资
------	--

	者带来稳定回报。
投资策略	以非债券资产 90%以上的资金对深证 100 指数的成份股进行股票指数化投资。股票指数化投资部分不得低于基金资产的 50%，采用复制法跟踪深证 100 指数，对于因流动性等原因导致无法完全复制深证 100 指数的情况，将采用剩余组合替换等方法避免跟踪误差扩大。
业绩比较基准	深证 100 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%
风险收益特征	风险和预期收益率接近市场平均水平

### 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	<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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	融通基金管理有限公司	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

## § 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	-341,938,082.75	-894,658,484.64	-1,095,504,729.46
本期利润	3,343,755,370.86	-535,914,168.23	250,690,807.23
加权平均基金份额本期利润	0.2630	-0.0361	0.0170
本期基金份额净值增长率	32.60%	-4.19%	2.14%
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	-0.1665	-0.1432	-0.0804
期末基金资产净值	12,476,977,601.52	12,528,136,846.02	14,547,973,622.39
期末基金份额净值	1.212	0.914	0.954

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

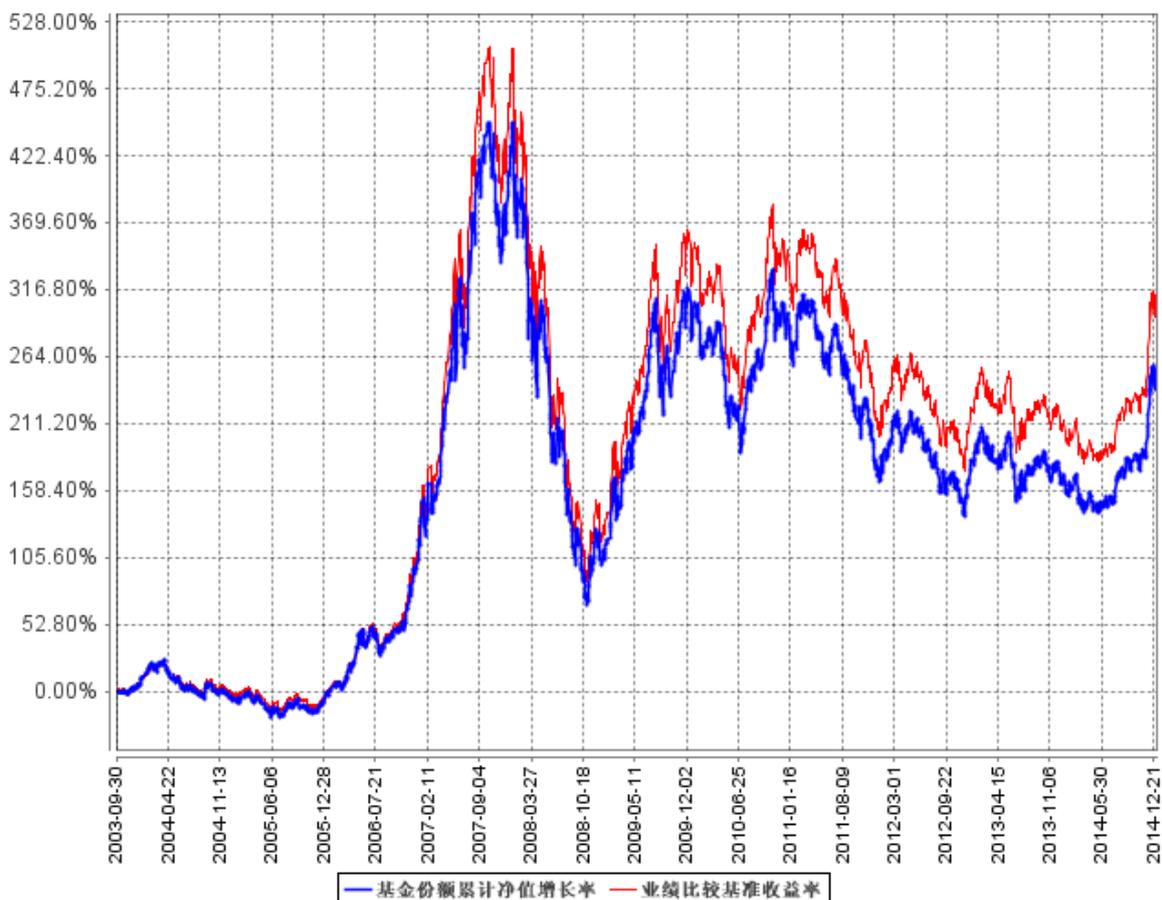
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	26.51%	1.44%	26.29%	1.41%	0.22%	0.03%
过去六个月	42.09%	1.20%	41.78%	1.18%	0.31%	0.02%
过去一年	32.60%	1.16%	32.84%	1.15%	-0.24%	0.01%
过去三年	29.76%	1.30%	32.96%	1.30%	-3.20%	0.00%
过去五年	-12.07%	1.38%	-8.27%	1.38%	-3.80%	0.00%
自基金合同生效起至今	258.06%	1.70%	316.05%	1.69%	-57.99%	0.01%

注：本基金业绩比较基准项目分段计算，其中：2005 年 8 月 21 日之前（含此日）采用“深证 100 指数×75%+银行间债券综合指数×25%”，2005 年 8 月 22 日起使用新基准即“深证 100 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%”。

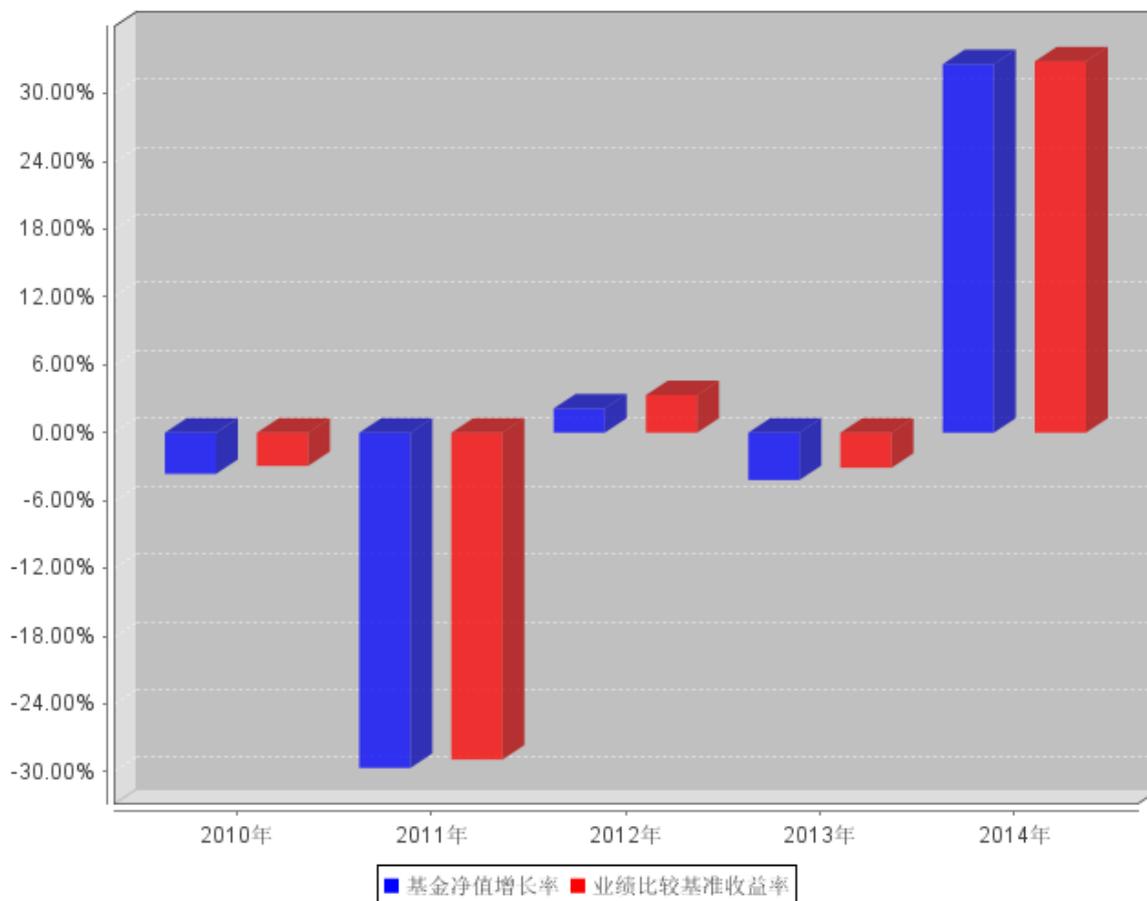
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 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

无。

## § 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		
王建强	本基金的基金经理、融通巨潮 100 指数基金（LOF）基金经理、融通深证成份指数基金基金经理、融通创业板指数基金基金经理	2009年5月15日	-	11	本科学历，具有证券从业资格。2001年至2004年就职于上海市万得信息技术股份有限公司；2004年至今就职于融通基金管理有限公司，历任金融工程研究员、基金经理助理职务。
何天翔	本基金的基金经理	2014年10月25日	-	6	硕士，具有基金从业资格。2008年7月至2010年3月在华泰联合证券有限公司工作，任金融工程分析师；2010年3月加入融通基金管理有限公司，历任金融工程研究员、专户投资投资经理。

注：(1). 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。

(2). 自 2015 年 1 月 9 日起，王建强先生不再担任本基金的基金经理，由何天翔先生继续担任本基金的基金经理。具体内容请参阅 2015 年 1 月 9 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。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《融通通利系列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

在严格遵守基金合同的前提下实现持有人利益的最大化是本基金管理的核心思想，并将此原则贯彻于基金的运作始终。本基金运用指数化投资策略，通过控制股票投资权重与深证 100 指数成份股自然权重的偏离，有效控制跟踪误差，为投资者提供投资深 100 指数的一个有效工具。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金份额净值增长率为 32.60%，基金业绩比较基准收益率为 32.84%。

#### 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，在稳增长和继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策等宏观环境下，以及在利率水平下行预期和低通胀预期下，宏观经济将逐渐企稳甚至回升，因此我们对宏观经济持相对

乐观态度。对于证券市场同样持相对乐观态度，但需要提防指数波动率的上升。行业走势将继续分化，看好由自上而下的政策和改革驱动，以及由自下而上的业绩驱动的行业和板块。

#### 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-0.1665 元，依据基金合同的约定，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

本报告期内，本基金托管人在对融通深证 100 指数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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，融通深证 100 指数证券投资基金的管理人——融通基金管理有限公司在融通深证 100 指数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，融通深证 100 指数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深证 100 指数证券投资基金 2014 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 20500 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：融通深证 100 指数证券投资基金

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	122,937,154.95	230,936,436.00
结算备付金	1,743,342.59	1,530,832.85
存出保证金	661,216.83	737,471.32
交易性金融资产	12,316,501,479.05	12,357,377,482.34
其中：股票投资	11,815,691,479.05	11,780,611,482.34
基金投资	-	-
债券投资	500,810,000.00	576,766,000.00
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	-	43,750,221.88
应收证券清算款	128,839,822.00	-
应收利息	17,381,835.19	13,861,978.32

应收股利	-	-
应收申购款	9,475,529.10	5,497,856.08
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	12,597,540,379.71	12,653,692,278.79
<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	-	91,103,302.93
应付赎回款	103,042,090.05	15,886,823.09
应付管理人报酬	10,649,833.79	10,914,468.17
应付托管费	2,129,966.78	2,182,893.62
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,000,698.97	3,419,933.65
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,740,188.60	2,048,011.31
负债合计	120,562,778.19	125,555,432.77
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	10,295,056,352.40	13,700,692,357.66
未分配利润	2,181,921,249.12	-1,172,555,511.64
所有者权益合计	12,476,977,601.52	12,528,136,846.02
负债和所有者权益总计	12,597,540,379.71	12,653,692,278.79

注:报告截止日 2014 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.212 元,基金份额总额 10,295,056,352.40 份。

## 7.2 利润表

会计主体: 融通深证 100 指数证券投资基金

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>	3,499,291,376.27	-347,783,298.11
1. 利息收入	22,538,329.96	20,618,747.97

其中：存款利息收入	1,026,945.01	1,261,771.26
债券利息收入	21,507,660.28	19,351,743.67
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3,724.67	5,233.04
其他利息收入	-	-
2. 投资收益	-209,939,132.51	-728,700,531.53
其中：股票投资收益	-388,086,101.75	-917,063,950.31
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,610,805.21	131,900.88
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	176,536,164.03	188,231,517.90
3. 公允价值变动收益	3,685,693,453.61	358,744,316.41
4. 汇兑收益	-	-
5. 其他收入	998,725.21	1,554,169.04
<b>减：二、费用</b>	155,536,005.41	188,130,870.12
1. 管理人报酬	115,628,951.38	141,312,129.16
2. 托管费	23,125,790.31	28,262,425.77
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	16,462,140.83	18,230,827.31
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	319,122.89	325,487.88
<b>三、利润总额</b>	3,343,755,370.86	-535,914,168.23
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润</b>	3,343,755,370.86	-535,914,168.23

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通深证 100 指数证券投资基金

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）	13,700,692,357.66	-1,172,555,511.64	12,528,136,846.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,343,755,370.86	3,343,755,370.86
三、本期基金份额交易	-3,405,636,005.26	10,721,389.90	-3,394,914,615.36

产生的基金净值变动数			
其中：1. 基金申购款	1,619,100,341.16	-75,218,929.30	1,543,881,411.86
2. 基金赎回款	-5,024,736,346.42	85,940,319.20	-4,938,796,027.22
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）	10,295,056,352.40	2,181,921,249.12	12,476,977,601.52
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）	15,247,940,461.07	-699,966,838.68	14,547,973,622.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-535,914,168.23	-535,914,168.23
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,547,248,103.41	63,325,495.27	-1,483,922,608.14
其中：1. 基金申购款	2,848,781,636.13	-135,531,676.07	2,713,249,960.06
2. 基金赎回款	-4,396,029,739.54	198,857,171.34	-4,197,172,568.20
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）	13,700,692,357.66	-1,172,555,511.64	12,528,136,846.02

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：孟朝霞 主管会计工作负责人：颜锡廉 会计机构负责人：刘美丽

## 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

本基金本报告期内无重大会计差错内容和更正金额。

#### 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	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

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。

##### 7.4.4.2 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	115,628,951.38	141,312,129.16
其中：支付销售机构的客户维护费	14,696,606.34	17,524,705.80

注：1、支付基金管理人融通基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.00% 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：日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.00% ÷ 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	23,125,790.31	28,262,425.77

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 0.20% 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 × 0.20% ÷ 当年天数。

#### 7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期及上年度可比期间本基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，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		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	
	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	122,937,154.95	893,400.99	230,936,436.00	1,012,957.56

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

注：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。

##### 7.4.4.7 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/增发而流通受限证券。

#### 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
000562	宏源证券	2014-12-10	换股 吸收合并	36.38	-	-	10,757,411	119,329,531.15	391,354,612.18	-
000009	中国宝安	2014-12-29	重大事项	12.95	2015-01-07	13.88	7,552,441	63,681,796.13	97,804,110.95	-
300315	掌趣科技	2014-07-14	重大事项	19.59	2015-02-16	17.41	3,196,332	56,118,370.74	62,616,143.88	-

注：1. 根据宏源证券公告，申银万国将向宏源证券全体股东发行 A 股股票，以换股比例 2.049：1 取得宏源证券股东持有的宏源证券全部股票，吸收合并宏源证券，2014 年 12 月 9 日为宏源证券最后一个交易日，合并后的申万宏源于 2015 年 1 月 26 日复牌。

2. 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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在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	11,815,691,479.05	93.79
	其中：股票	11,815,691,479.05	93.79
2	固定收益投资	500,810,000.00	3.98
	其中：债券	500,810,000.00	3.98
	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	124,680,497.54	0.99
7	其他各项资产	156,358,403.12	1.24
8	合计	12,597,540,379.71	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

## 8.2.1 期末指数投资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	195,423,581.24	1.57
C	制造业	6,233,616,572.12	49.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	83,778,391.12	0.67
E	建筑业	86,744,868.00	0.70
F	批发和零售业	258,020,560.71	2.07
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	622,933,767.28	4.99
J	金融业	2,286,439,484.74	18.33
K	房地产业	1,205,071,561.64	9.66
L	租赁和商务服务业	184,878,094.65	1.48
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	356,771,558.90	2.86
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	204,208,927.70	1.64
S	综合	97,804,110.95	0.78
	合计	11,815,691,479.05	94.70

## 8.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

## 8.3.1 期末指数投资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	000002	万 科 A	53,227,573	739,863,264.70	5.93
2	000651	格力电器	13,585,368	504,288,860.16	4.04
3	000001	平安银行	31,315,894	496,043,760.96	3.98
4	000776	广发证券	18,593,599	482,503,894.05	3.87
5	000562	宏源证券	10,757,411	391,354,612.18	3.14
6	000783	长江证券	21,690,276	364,830,442.32	2.92
7	000333	美的集团	11,151,470	305,996,336.80	2.45
8	000858	五 粮 液	10,511,380	225,994,670.00	1.81
9	002024	苏宁云商	23,993,027	215,937,243.00	1.73
10	000063	中兴通讯	11,136,223	201,120,187.38	1.61

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。

### 8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

## 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	002065	东华软件	132,669,801.34	1.06
2	002465	海格通信	111,764,851.98	0.89
3	002385	大北农	109,176,403.11	0.87
4	300058	蓝色光标	105,595,103.19	0.84
5	300124	汇川技术	97,631,581.37	0.78
6	300017	网宿科技	97,300,788.03	0.78
7	002241	歌尔声学	86,681,947.25	0.69
8	000039	中集集团	81,338,209.55	0.65
9	300002	神州泰岳	78,608,160.57	0.63
10	000831	五矿稀土	78,552,620.30	0.63
11	000625	长安汽车	73,660,412.21	0.59
12	000002	万 科 A	69,200,510.90	0.55
13	300024	机器人	68,767,365.47	0.55
14	000069	华侨城 A	67,768,191.83	0.54
15	300315	掌趣科技	61,385,505.45	0.49
16	300104	乐视网	60,189,559.42	0.48
17	002292	奥飞动漫	52,086,202.30	0.42

18	002230	科大讯飞	49,010,966.74	0.39
19	002142	宁波银行	48,950,002.20	0.39
20	000538	云南白药	45,314,184.05	0.36

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	000002	万科A	272,232,352.62	2.17
2	000651	格力电器	237,229,037.52	1.89
3	300104	乐视网	145,192,056.80	1.16
4	000001	平安银行	141,925,042.20	1.13
5	002241	歌尔声学	141,444,724.62	1.13
6	000538	云南白药	141,360,181.40	1.13
7	000776	广发证券	133,240,122.90	1.06
8	300024	机器人	125,124,930.80	1.00
9	000039	中集集团	120,719,919.97	0.96
10	002230	科大讯飞	114,538,585.03	0.91
11	000333	美的集团	107,390,805.10	0.86
12	002024	苏宁云商	106,506,695.45	0.85
13	000625	长安汽车	105,848,495.23	0.84
14	000783	长江证券	104,585,133.61	0.83
15	000069	华侨城A	101,798,941.49	0.81
16	000858	五粮液	96,863,805.17	0.77
17	002142	宁波银行	95,517,177.22	0.76
18	002008	大族激光	88,953,449.46	0.71
19	300070	碧水源	84,288,267.76	0.67
20	002415	海康威视	82,134,759.67	0.66

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	3,313,406,983.71
卖出股票收入（成交）总额	6,573,568,607.77

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	500,810,000.00	4.01
	其中：政策性金融债	500,810,000.00	4.01
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	500,810,000.00	4.01

**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	140429	14 农发 29	2,000,000	200,340,000.00	1.61
2	140207	14 国开 07	2,000,000	200,300,000.00	1.61
3	140430	14 农发 30	1,000,000	100,170,000.00	0.80

**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。

8.12.2 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	661,216.83
2	应收证券清算款	128,839,822.00
3	应收股利	-
4	应收利息	17,381,835.19
5	应收申购款	9,475,529.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	156,358,403.12

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

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000562	宏源证券	391,354,612.18	3.14	换股吸收合并停牌

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

## § 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
602, 713	17, 081. 19	201, 556, 429. 08	1. 96%	10, 093, 499, 923. 32	98. 04%

### 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	5, 972, 146. 73	0. 0580%

### 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、基金投资和研究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 (2003 年 9 月 30 日) 基金份额总额	477, 689, 377. 16
本报告期期初基金份额总额	13, 700, 692, 357. 66
本报告期基金总申购份额	1, 619, 100, 341. 16
减: 本报告期基金总赎回份额	5, 024, 736, 346. 42
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	10, 295, 056, 352. 40

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期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 本报告期基金管理人的重大人事变动

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 本报告期基金托管人的重大人事变动

本报告期内，因中国工商银行工作需要，周月秋同志不再担任工商银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工商银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

在本报告期内没有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金的投资策略未发生变更。

### 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 170,000.00 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，基金管理人、托管人及其高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情形。

### 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	
光大证券	1	2,791,482,026.82	28.23%	2,470,184.79	28.23%	-
中信证券	2	1,288,799,804.29	13.04%	1,140,461.26	13.04%	-
申银万国	1	1,102,421,571.61	11.15%	975,533.92	11.15%	-
长江证券	1	1,032,691,412.23	10.44%	913,829.18	10.44%	-
海通证券	1	935,103,212.74	9.46%	827,473.19	9.46%	-
华泰证券	1	747,014,659.03	7.56%	661,034.68	7.56%	-
安信证券	1	706,293,773.62	7.14%	624,999.95	7.14%	-
长城证券	1	477,927,704.87	4.83%	422,919.51	4.83%	-
中金公司	1	339,786,081.99	3.44%	300,677.33	3.44%	-
平安证券	1	269,797,659.94	2.73%	238,744.03	2.73%	-
广州证券	1	195,657,684.34	1.98%	173,137.53	1.98%	-

中山证券	1	-	-	-	-	-
中信万通	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、本报告期内基金租用交易单元无变更。

#### 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

本基金本报告期无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

融通基金管理有限公司  
二〇一五年三月二十六日