

# 融通动力先锋股票型证券投资基金 2014 年年度报告

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 重要提示及目录

### 1.1 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。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 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.....	13
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	14
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>14</b>
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>15</b>
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4 报表附注.....	18
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>37</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	37
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	38
8.3 期末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.....	38
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	45
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.....	45
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.....	45
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.....	45
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	45

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	46
8.12 投资组合报告附注 .....	46
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>47</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	47
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
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 .....	47
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>47</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>47</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	47
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 .....	48
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
11.4 基金投资策略的改变 .....	48
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	48
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 .....	48
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
11.8 其他重大事件 .....	51
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>55</b>

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	融通动力先锋股票型证券投资基金
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增长硕果，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
注册地址		深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518053	100140
法定代表人		田德军	姜建清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
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

## 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	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
本期加权平均净值利润率	38.56%	18.78%	2.66%
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
期末可供分配利润	581,651,550.52	-312,271,214.21	-603,624,897.27
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
3.1.3 累计期末指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
基金份额累计净值增长率	134.52%	62.51%	33.91%

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）。

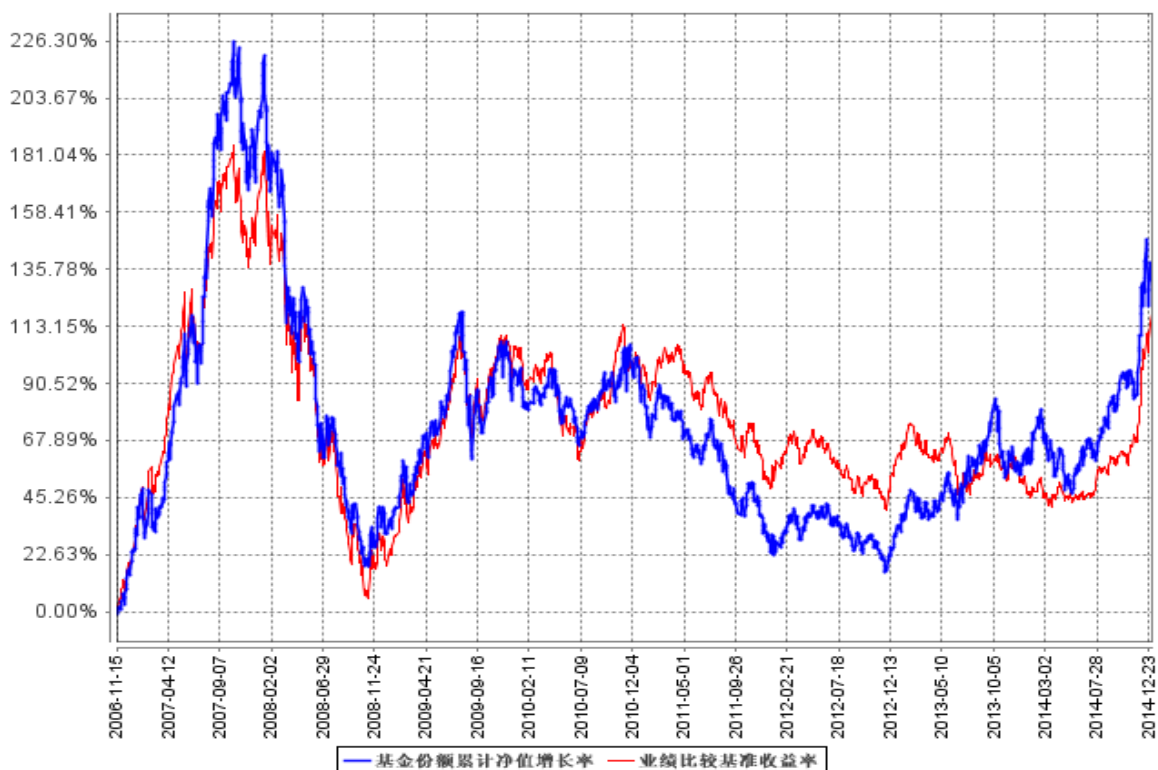
### 3.2 基金净值表现

#### 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

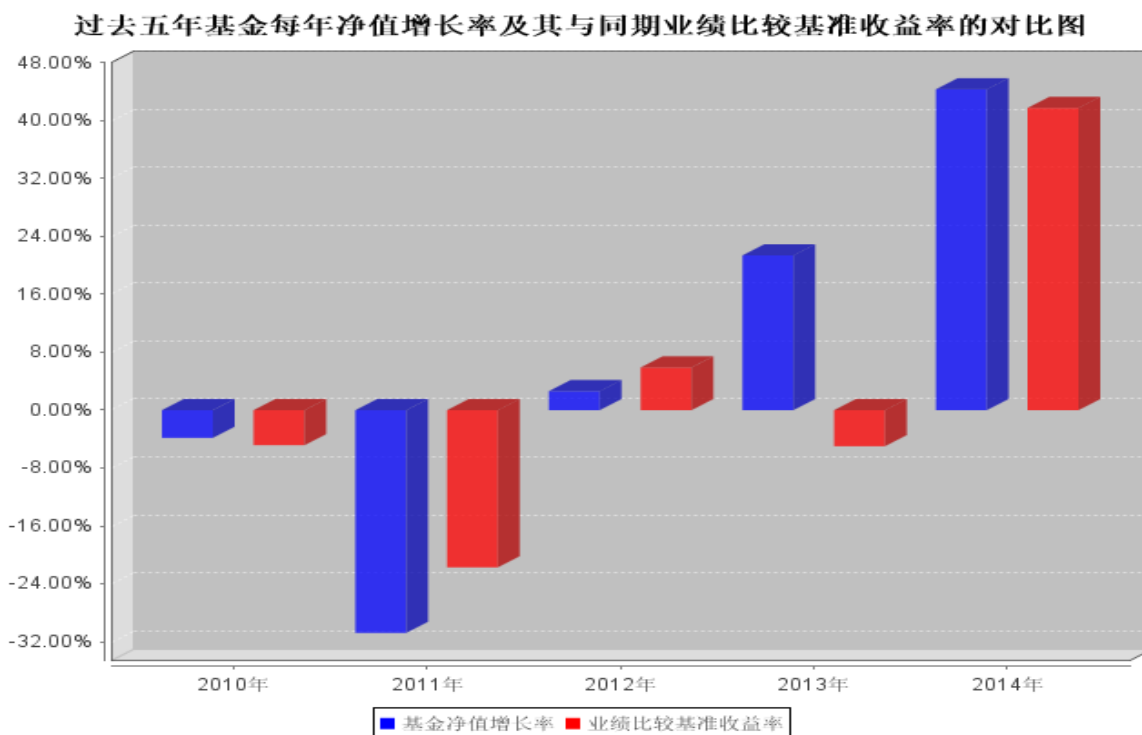
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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有限公司。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

基金管理人坚持一切从保护基金持有人利益出发，继续致力于内控制度与机制的完善，加强合规控制与风险防范，确保基金运作符合法律法规和基金合同的要求。公司监察稽核部门通过合规审核、实时监控及专项检查等方法，对基金运作和公司管理进行独立的监察稽核，及时发现风险隐患，提出整改建议，并督促跟踪业务部门进行整改。

在专项稽核方面，公司监察稽核部门针对不同业务环节的风险特点，制定年度检查计划，并结合对各风险点风险程度的实时判断和评估，按照不同的检查频率，对投资决策、研究支持、交易执行、基金销售、后台运营、信息披露及员工职业操守管理等方面的重点业务环节进行专项检查，检查有关业务执行的合规性和风险控制措施的有效性，检查项目覆盖了相关业务的主要风险点。本报告期内，特别加大了对投资管理人员管控措施、投资决策流程及决策依据、交易执行及

后台运作风险等敏感、重点项目的关注，确保基金运作的稳健合规。本基金管理人全年未发生合规及风险事故。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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

普华永道中天审字(2015)第 20510 号

融通动力先锋股票型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的融通动力先锋股票型证券投资基金(以下简称“融通动力先锋股票基金”)的财务报表，包括 2014 年 12 月 31 日的资产负债表、2014 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

### 一、 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是融通动力先锋股票基金的基金管理人融通基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“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财务报表，并使其实现公允反映；

(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

### 二、 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 三、 审计意见

我们认为，上述融通动力先锋股票基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财

务报表附注中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，公允反映了融通动力先锋股票基金 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天  
会计师事务所(特殊普通合伙)

注册会计师 汪 棣

中国·上海市

注册会计师 王 灵

2015 年 3 月 20 日

## § 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	附注号	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	7.4.7.1	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	7.4.7.2	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	49,958,224.98
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	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	7.4.7.6	-	-

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>附注号</b>	<b>本期末 2014年12月31日</b>	<b>上年度末 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	7.4.7.3	-	-
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	7.4.7.7	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	7.4.7.8	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	7.4.7.9	1,649,056,108.88	1,912,960,238.06
未分配利润	7.4.7.10	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	附注号	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
<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	7.4.7.11	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	7.4.7.12	830,575,592.87	354,873,655.71
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	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	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	9,458,827.50	11,307,803.75
3. 公允价值变动收益	7.4.7.16	-21,965,810.09	76,069,349.47
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	7.4.7.17	470,283.93	351,697.25
<b>减：二、费用</b>		68,983,040.76	69,140,824.73
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	29,418,183.43	30,254,773.94
2. 托管费	7.4.10.2.2	4,903,030.59	5,042,462.28
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	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	7.4.7.19	515,707.74	424,573.96
<b>三、利润总额</b>		755,474,624.82	379,045,825.92
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润</b>		755,474,624.82	379,045,825.92

### 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 基金基本情况

融通动力先锋股票型证券投资基金(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”)证监基金字[2006]第183号《关于同意融通动力先锋股票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《融通动力先锋股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,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3,363,270,255.72元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第167号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《融通动力先锋股票型证券投资基金基金合同》于2006年11月15日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为3,364,280,448.23份基金份额,其中认购资金利息折合1,010,192.51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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通动力先锋股票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，包括国内依法发行上市的股票、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 60%-95%，债券为 0%-40%，权证的投资比例为基金净资产的 0%-3%，并保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。自基金合同生效日至 2013 年 6 月 30 日，本基金的业绩比较基准为：富时中国 A600 指数(原新华富时 A600 指数)收益率×80%+新华巴克莱资本中国全债指数(原新华雷曼中国全债指数)收益率×20%。根据本基金的基金管理人于 2013 年 6 月 28 日发布的《关于变更融通动力先锋股票型证券投资基金业绩比较基准及修改基金合同的公告》，自 2013 年 7 月 1 日起，本基金业绩比较基准变更为：沪深 300 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%。

#### 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《融通动力先锋股票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 2014 年度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 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度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。

##### 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卖出回购金融资产款和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在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和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。

#### 7.4.4.11 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，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。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。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

（2）对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会基金部通知[2006]37号《关于加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

#### 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

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。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末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须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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
活期存款	38,519,808.57	80,197,375.67
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计	38,519,808.57	80,197,375.67

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,399,119,090.05	2,571,446,381.49	172,327,291.44
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,901,000.00	2,707,404.20
	银行间市场	100,223,530.00	100,045,000.00
	合计	102,124,530.00	102,752,404.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,501,243,620.05	2,674,198,785.69	172,955,165.64
项目	上年度末 2013 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,819,635,552.83	2,014,293,309.58	194,657,756.75
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,901,000.00	2,375,109.40
	银行间市场	99,510,890.42	99,300,000.00
	合计	101,411,890.42	101,675,109.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-



合计	1,921,047,443.25	2,115,968,418.98	194,920,975.73
----	------------------	------------------	----------------

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_交易所	-	-
买入返售证券_银行间	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2013年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_交易所	-	-
买入返售证券_银行间	49,958,224.98	-
合计	49,958,224.98	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
应收活期存款利息	10,538.03	40,981.99
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	7,330.50	7,339.70
应收债券利息	2,665,850.88	860,953.64
应收买入返售证券利息	-	4,267.39
应收申购款利息	-	-
其他	683.70	1,012.70
合计	2,684,403.11	914,555.42

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2014 年 12 月 31 日	2013 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	11,599,279.11	7,996,462.83
银行间市场应付交易费用	700.00	3,551.47
合计	11,599,979.11	8,000,014.30

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	750,000.00	1,000,000.00
预提费用	100,000.00	204,500.00
应付赎回费	7,722.59	107.52
应付后端申购费	876.17	177.70
合计	858,598.76	1,204,785.22

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,912,960,238.06	1,912,960,238.06
本期申购	421,595,280.02	421,595,280.02
本期赎回	-685,499,409.20	-685,499,409.20
本期末	1,649,056,108.88	1,649,056,108.88

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-312,271,214.21	583,028,509.32	270,757,295.11
本期利润	777,440,434.91	-21,965,810.09	755,474,624.82
本期基金份额交易产生的变动数	116,482,329.82	-73,917,078.82	42,565,251.00
其中：基金申购款	84,008,268.87	132,762,104.92	216,770,373.79
基金赎回款	32,474,060.95	-206,679,183.74	-174,205,122.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	581,651,550.52	487,145,620.41	1,068,797,170.93

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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

活期存款利息收入	1,165,168.43	1,332,309.10
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	120,777.70	143,266.29
其他	107,850.90	140,382.30
合计	1,393,797.03	1,615,957.69

## 7.4.7.12 股票投资收益

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
卖出股票成交总额	11,329,211,110.61	11,052,757,558.88
减：卖出股票成本总额	10,498,635,517.74	10,697,883,903.17
买卖股票差价收入	830,575,592.87	354,873,655.71

## 7.4.7.13 债券投资收益

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
卖出债券及债券到期兑付成交总额	103,955,989.04	109,487,519.10
减：卖出债券及债券到期兑付成本总额	99,510,890.42	105,760,100.00
减：应收利息总额	3,971,589.04	3,351,446.71
买卖债券差价收入	473,509.58	375,972.39

## 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度均无衍生工具收益。

## 7.4.7.15 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	9,458,827.50	11,307,803.75
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	9,458,827.50	11,307,803.75

## 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014年1月1日至2014	上年度可比期间 2013年1月1日至2013

	年 12 月 31 日	年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-21,965,810.09	76,069,349.47
——股票投资	-22,330,465.31	76,188,440.09
——债券投资	364,655.22	-119,090.62
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——基金投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-21,965,810.09	76,069,349.47

## 7.4.7.17 其他收入

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
基金赎回费收入	455,126.92	195,761.92
基金转换费收入	15,157.01	81.99
其他	-	155,853.34
合计	470,283.93	351,697.25

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、基金转换收取转换费和补差费，其中转换费的 25% 归入转出基金的基金资产。

## 7.4.7.18 交易费用

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
交易所市场交易费用	34,076,337.34	33,419,014.55
银行间市场交易费用	900.00	-
合计	34,077,237.34	33,419,014.55

## 7.4.7.19 其他费用

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
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	400,000.00	300,000.00
银行费用	2,207.74	6,573.96
债券账户维护费	13,500.00	18,000.00
合计	515,707.74	424,573.96

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要作说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 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%

###### 7.4.10.1.2 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。

###### 7.4.10.1.3 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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 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	30,254,773.94
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。

##### 7.4.10.2.2 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
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：

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

##### 7.4.10.3 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。

## 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

## 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

## 7.4.10.4.2 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。

## 7.4.10.5 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。

## 7.4.10.6 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。

## 7.4.10.7 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。

## 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

## 7.4.12 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 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。

## 7.4.12.2 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 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。

##### 7.4.12.3.2 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是主动型股票基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行建设全面风险管理体系、风控优先的政策，在董事会下设立合规与审计委员会，负责检查公司合规运作的状况及合规控制的有效性，并对公司的合规控制提出相关要求；在管理层层面设立风险控制委员会，负责建立健全公司的风险管理制度并组织实施，审定公司的业务风险管理政策，审定公司内控管理组织实施方案，审定公司的业务授权方案，审定基金资产组合的风险状况评价分析报告，审定公司各项风险与内控状况评价报告，审定业务风险损失责任人的责任，审定重大业务可行性风险论证，协调突发性重大风险事件的处理；各业务部门在执行业务事项时需遵守相关法律法规，遵守公司业务管理制度，具有根据业务特点控制业务风险的职责。业务人员是风险控制环节的第一责任人，部门负责人是控制业务风险管理的第一责任人，对部门风险控制措施的实施情况进行管理；风险管理小组由投资经理、金融工程人员和研究员组成，负责制定相关业务风险的识别和度量方法，指导业务部门实施风险的管理和控制，并定期出具投资组合风险报告，进行投资风险分析与绩效评估；督察长和监察稽核部负责监察公司各业务部门在相关法律法规、规章制度和业务流程执行方面的情况，确保既定的风险控制措施得到有效的贯彻执行，发现内控缺失和管理漏洞，提出改进要求和建议，并报告法规和制度的执行情况。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工



具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2014 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.10%(2013 年 12 月 31 日：0.11%)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过

卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2014 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014 年 12 月 31 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	38,519,808.57	-	-	-	38,519,808.57
结算备付金	16,289,930.80	-	-	-	16,289,930.80
存出保证金	1,519,420.94	-	-	-	1,519,420.94
交易性金融资产	100,045,000.00	2,707,404.20	-	2,571,446,381.49	2,674,198,785.69
应收利息	-	-	-	2,684,403.11	2,684,403.11
应收申购款	1,005,652.00	-	-	10,572,893.21	11,578,545.21
资产总计	157,379,812.31	2,707,404.20	-	2,584,703,677.81	2,744,790,894.32
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,625,111.01	10,625,111.01
应付管理人报酬	-	-	-	3,303,364.82	3,303,364.82
应付托管费	-	-	-	550,560.81	550,560.81
应付交易费用	-	-	-	11,599,979.11	11,599,979.11
其他负债	-	-	-	858,598.76	858,598.76

负债总计	-	-	-	26,937,614.51	26,937,614.51
利率敏感度缺口	157,379,812.31	2,707,404.20	-	2,557,766,063.30	2,717,853,279.81
上年度末 2013 年 12 月 31 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	80,197,375.67	-	-	-	80,197,375.67
结算备付金	16,310,509.28	-	-	-	16,310,509.28
存出保证金	2,250,541.10	-	-	-	2,250,541.10
交易性金融资产	99,300,000.00	2,375,109.40	-	2,014,293,309.58	2,115,968,418.98
买入返售金融资产	49,958,224.98	-	-	-	49,958,224.98
应收利息	-	-	-	914,555.42	914,555.42
应收申购款	8,014.05	-	-	118,208.19	126,222.24
资产总计	248,024,665.08	2,375,109.40	-	2,015,326,073.19	2,265,725,847.67
负债					
应付证券清算款	-	-	-	66,771,282.62	66,771,282.62
应付赎回款	-	-	-	2,683,130.04	2,683,130.04
应付管理人报酬	-	-	-	2,870,659.12	2,870,659.12
应付托管费	-	-	-	478,443.20	478,443.20
应付交易费用	-	-	-	8,000,014.30	8,000,014.30
其他负债	-	-	-	1,204,785.22	1,204,785.22
负债总计	-	-	-	82,008,314.50	82,008,314.50
利率敏感度缺口	248,024,665.08	2,375,109.40	-	1,933,317,758.69	2,183,717,533.17

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2014 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 3.78% (2013 年 12 月 31 日：4.66%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2013 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，

结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 60%-95%，债券为 0%-40%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日		上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,571,446,381.49	94.61	2,014,293,309.58	92.24
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,571,446,381.49	94.61	2,014,293,309.58	92.24

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末(2014 年 12 月 31 日)	上年度末(2013 年 12 月 31 日)
	1. 沪深 300 指数上升 5%	103,278,424.63	96,083,131.46
2. 沪深 300 指数下降 5%	-103,278,424.63	-96,083,131.46	

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

## (i) 各层次金融工具公允价值

于2014年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为2,562,069,412.09元，属于第二层次的余额为112,129,373.60元，无属于第三层次的余额(2013年12月31日：第一层次1,961,413,218.98元，第二层次154,555,200.00元，无第三层次)。

## (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

## (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

## (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2014年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2013年12月31日：同)。

## (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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所有股票投资明细

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
11	600862	南通科技	9,520,625	88,351,400.00	3.25
12	601688	华泰证券	3,499,945	85,643,654.15	3.15
13	601788	光大证券	2,999,976	85,619,315.04	3.15
14	000783	长江证券	4,700,000	79,054,000.00	2.91
15	000001	平安银行	3,999,964	63,359,429.76	2.33
16	601336	新华保险	1,200,000	59,472,000.00	2.19
17	600036	招商银行	3,499,997	58,064,950.23	2.14
18	000666	经纬纺机	3,049,549	54,891,882.00	2.02
19	000776	广发证券	2,000,000	51,900,000.00	1.91
20	600383	金地集团	4,299,997	49,062,965.77	1.81
21	600369	西南证券	2,000,000	44,580,000.00	1.64
22	000402	金融街	2,199,932	27,125,161.56	1.00
23	000597	东北制药	2,299,910	24,356,046.90	0.90
24	000728	国元证券	727,951	22,690,232.67	0.83
25	600446	金证股份	259,998	12,188,706.24	0.45
26	300347	泰格医药	399,880	12,084,373.60	0.44
27	600775	南京熊猫	1,000,000	10,370,000.00	0.38
28	600109	国金证券	499,965	9,894,307.35	0.36
29	600812	华北制药	1,000,000	6,190,000.00	0.23
30	300307	慈星股份	500,000	4,315,000.00	0.16
31	300226	上海钢联	50,000	3,018,500.00	0.11
32	000758	中色股份	200,000	2,938,000.00	0.11
33	601233	桐昆股份	250,000	2,650,000.00	0.10
34	300239	东宝生物	20,000	220,200.00	0.01
35	002197	证通电子	1	15.49	0.00

#### 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	中科金财	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（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) 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	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	融通基金管理有限公司关于设立香港子公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-1-7
2	融通基金管理有限公司关于旗下基金所持有的新华医疗估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-2-26
3	融通基金关于网上直销平台调整基金转换业务费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-3-21
4	关于融通基金参加深圳众禄基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司申购费率优惠的费率调整公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-3-21
5	融通基金管理有限公司关于旗下基金所持有的“恒生电子”和“金证股份”估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-3-29
6	关于融通旗下开放式基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-3-31
7	融通基金管理有限公司关于旗下基金所持有的“乐普医疗”估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-4-1
8	融通基金关于新增浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-4-8
9	融通基金关于新增一路财富（北京）信息科技有限公司为代销机构及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-4-23
10	融通基金管理有限公司关于旗下基金所持有的“光线传媒”估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-4-26
11	融通基金管理有限公司关于旗下基金所持有的“誉衡药业”估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-4-29
12	融通基金关于新增嘉实财富管理有限公司为代销机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-5-16
13	融通基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低申购金额、定期定额投资金额、最低赎回份额要求和最低保有份额限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-5-23
14	融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金在	中国证券报、上海证券报、	2014-5-27

	中国建设银行新增开通基金转换业务的公告	证券时报、证券日报、管理人网站	
15	融通基金关于网上直销费率优惠及开通转换业务的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-5-27
16	融通基金管理有限公司关于旗下基金持有的“13 宛城投”债券估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-5-29
17	融通动力先锋股票型证券投资基金暂停申购的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-5-29
18	关于融通基金参加杭州数米基金销售有限公司申购费率优惠的费率调整公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-6-3
19	融通动力先锋股票型证券投资基金恢复申购的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-6-5
20	融通基金关于新增中国国际期货有限公司为代销机构及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-6-6
21	关于融通旗下部分开放式基金参加华泰证券股份有限公司基金定投申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-6-12
22	融通基金关于新增北京钱景财富投资管理有限公司为代销机构及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-6-13
23	融通基金关于新增太平洋证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-6-23
24	融通基金管理有限公司关于公司旗下基金所持有的“上海绿新”估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-7-1
25	融通基金关于开通交通银行借记卡进行网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-7-15
26	关于公司旗下基金所持有的“恒康医疗”估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-8-2
27	关于公司旗下基金所持有的“华邦颖泰”估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-8-5
28	关于融通旗下部分开放式基金参加华龙证券有限责任公司基金申购（含定投）费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-8-8

29	关于所持有的”尚荣医疗“和”华策影视“估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-8-19
30	基金经理增聘公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-8-21
31	融通基金关于开通中国银行借记卡进行网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-9-1
32	融通动力先锋股票型证券投资基金基金经理离任公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-9-2
33	关于所持有的“闽福发 A”和“广船国际”估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-9-3
34	融通基金管理有限公司关于公司旗下基金所持有的“石基信息”估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-9-4
35	融通基金管理有限公司关于旗下基金所持有的“神州泰岳”估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-9-5
36	融通基金管理有限公司关于旗下基金所持有的“东华软件”估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-9-13
37	融通基金管理有限公司关于高管人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-9-25
38	关于所持有的“金禾实业”估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-9-27
39	融通基金管理有限公司关于旗下基金所持有的“掌趣科技”估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-10-8
40	关于工行卡网上直销优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-10-22
41	融通基金管理有限公司关于公司旗下基金所持有的“凯利泰”估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-11-4
42	融通基金关于网上直销开通货币基金与开放式基金后端收费模式基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-11-7
43	融通基金关于调整中国银行卡网上直销基金转换费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管	2014-11-7

		理人网站	
44	融通基金管理有限公司关于参加上海天天基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-11-7
45	融通基金关于调整基金转换业务的转换份额下限的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-11-20
46	融通基金关于暂停银联支付渠道客户网上基金交易功能的通知	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-11-21
47	关于公司所持有的“乐视网”估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-12-3
48	融通基金管理有限公司关于公司旗下基金所持有的“三花股份”和“长园集团”估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-12-5
49	关于所持有的“闽福发 A”和“安控科技”估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-12-10
50	关于持有的“13 铜城建”债券估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-12-11
51	关于公司所持有的“中国铁建”和“绿盟科技”估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-12-16
52	关于公司所持有的“宏源证券”估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-12-18
53	融通基金关于公司旗下基金所持有的“太极集团”估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-12-20
54	关于融通旗下部分开放式基金参加华泰证券股份有限公司基金申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-12-23
55	融通基金管理有限公司关于公司旗下基金所持有的“宋城演艺”估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-12-23
56	融通基金关于新增恒丰银行股份有限公司为代销机构及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-12-29
57	融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金在中国农业银行开通基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-12-30
	关于融通旗下开放式基金参加中国工商银行	中国证券报、上海证券报、	2014-12-31

58	“2015 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	证券时报、证券日报、管理人网站	
59	关于融通旗下部分开放式基金参加平安银行基金申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-12-31
60	融通基金管理有限公司关于高管人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2014-12-31

### § 12 备查文件目录

(一)中国证监会批准融通动力先锋股票型证券投资基金设立的文件

(二)《融通动力先锋股票型证券投资基金基金合同》

(三)《融通动力先锋股票型证券投资基金托管协议》

(四)《融通动力先锋股票型证券投资基金招募说明书》及其更新

(五)《融通基金管理有限公司开放式基金业务管理规则》

(六)融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照

(七)基金托管人中国工商银行业务资格批件和营业执照

存放地点：基金管理人、基金托管人处

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件,或登陆本基金管理人网站 [www.rtfund.com](http://www.rtfund.com) 查询。