

融通通泽灵活配置混合型证券投资基金
(原融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金转型)

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本基金基金合同规定，于2015年3月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

融通通泽灵活配置混合型证券投资基金由融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金转型而成。根据融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议，融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金展期并转型为融通通泽灵活配置混合型证券投资基金，转型后本基金的投资目标、投资范围和策略均与转型前基金相同。

自2014年9月2日起，转型后的《融通通泽灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效。

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。

因本基金转型前后投资目标、投资范围、投资策略及业绩比较基准等均与转型前相同，所以本报告财务数据部分内容按年度报告期统一编制，不分转型前后，本年度报告期自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	融通通泽灵活配置混合
基金主代码	000278
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月2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	235,493,342.00份
基金合同存续期	不定期

注：本基金由《融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金》转型而来，融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效日为2013年8月30日。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求本金安全的基础上，通过大类资产配置与个券选择，采用数量化手段严格控制本基金的下行风险，力争在减小波动性的同时有效时间内为投资者创造8%的累计目标收益，为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。
投资策略	本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、行业细分、公司价值评估以及组合风险管理全过程中。
业绩比较基准	年化收益率8%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		融通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	涂卫东	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、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8月30日(基金合同生效日)-2013年12月31日
本期已实现收益	55,424,419.06	-46,852,461.74
本期利润	52,051,184.14	-32,942,977.54

加权平均基金份额本期利润	0.0680	-0.0379
本期基金份额净值增长率	11.99%	0.00%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0060	-0.0539
期末基金资产净值	235,129,696.52	836,361,111.44
期末基金份额净值	0.998	0.962

注：（1）本基金由《融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金》转型而来，融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效日为 2013 年 8 月 30 日，因本基金转型前后投资目标、投资范围策略及业绩比较基准均与转型前相同，上述指标计算不再分转型前后。

（2）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（3）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（4）期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	11.30%	1.83%	2.02%	0.00%	9.28%	1.83%
过去六个月	20.92%	1.35%	4.01%	0.02%	16.91%	1.33%
过去一年	11.99%	1.20%	8.00%	0.02%	3.99%	1.18%
自基金合同生效起至今	7.73%	1.06%	10.72%	0.02%	-2.99%	1.04%

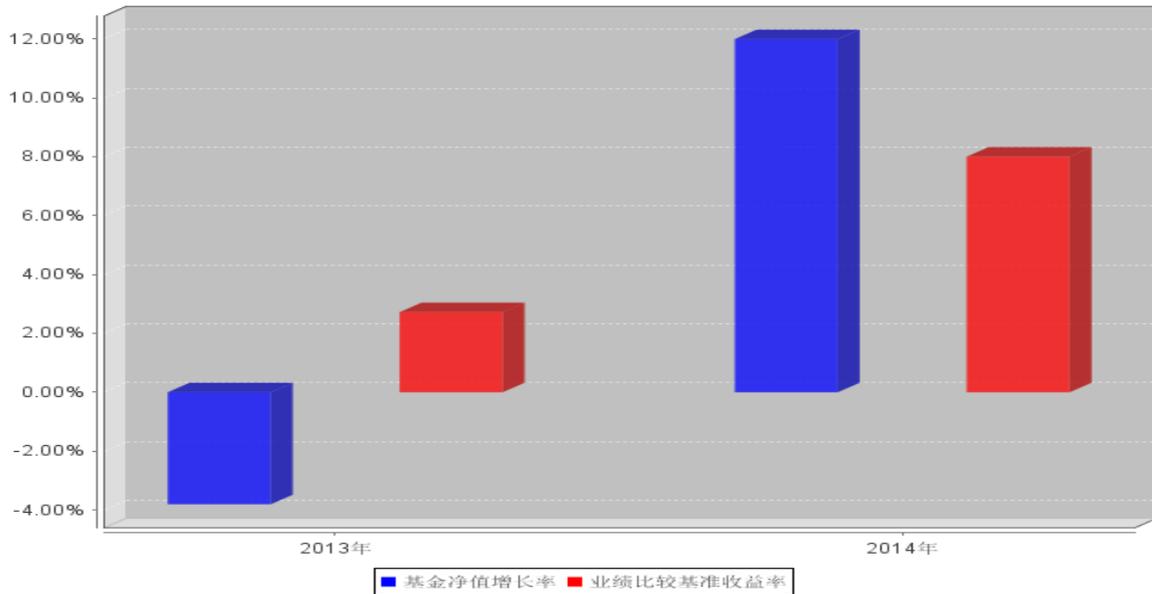
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



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	0.8000	19,007,221.28	246,678.68	19,253,899.96	
2013	-	-	-	-	
合计	0.8000	19,007,221.28	246,678.68	19,253,899.96	

§ 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	本基金的 基金经 理、融通 动力先锋 股票基金 的基金经 理	2014年9月2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。
周珺	本基金的基金经理、融通内需驱动基金的基金经理	2014年9月2日	2014年10月17日	6	硕士,具有基金从业资格。2008年3月至今,就职于融通基金管理有限公司,从事宏观策略研究、行业研究、周期性研究工作。

注:(1)任职日期根据基金管理人对外披露的任职日期填写;证券从业年限以从事证券业务相关的工作时间为计算标准;

(2)2015年2月25日起,增聘余志勇先生担任本基金的基金经理,与丁经纬先生共同管理本基金。具体内容请参阅2015年2月25日在《上海证券报》上刊登的相关公告。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《融通通泽灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为。基金投资组合符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了保证旗下的不同投资组合得到公平对待,本基金管理人制定了《融通基金管理有限公司公平交易制度》,公平交易制度所规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动,并涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

本基金管理人通过建立科学的投资决策体系,加强交易执行环节的内部控制,并通过工作制度、流程和技术手段来保证公平交易原则的实现。同时,本基金管理人通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本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。

4.3.3 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

报告期内，作为国内第一只目标触发式创新产品，融通通泽经历了业绩不达预期而被迫转型的困难，同时，也经历了转型后快速将净值掰回面值，并最终在迟到 4 个月后顺利实现了一次分红，在此，我们向所有通泽的持有人表示深深的感谢。

新的一年，融通通泽将继续秉承绝对收益理念，不求排名，只求绝对回报，在目前市场整体向上的环境下适当建仓，同时坚持积极稳健，控制回撤的原则，力争年内能够做到多次对持有人进行分红。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金净值份额净值增长率为 11.99%，业绩比较基准增长率为 8.00%。

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、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

本基金于2014年12月24日实施2014年度第1次利润分配，以2014年12月22日的可分配收益为基准，每10份基金份额派发现金红利0.800元。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对融通通泽灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，融通通泽灵活配置混合型证券投资基金的管理人——融通基金管理有限公司在融通通泽灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，融通通泽灵活配置混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了1次利润分配，分配金额为19,253,899.96元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对融通基金管理有限公司编制和披露的融通通泽灵活配置混合型证券投资基金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20496号），投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：融通通泽灵活配置混合型证券投资基金

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
资产：		
银行存款	50,750,487.82	298,768,810.21
结算备付金	4,677,901.70	17,972,714.39
存出保证金	1,107,059.10	423,446.38
交易性金融资产	182,573,714.38	510,273,563.71
其中：股票投资	182,573,714.38	390,114,201.52
基金投资	-	-
债券投资	-	120,159,362.19

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	-	59,850,229.93
应收证券清算款	-	-
应收利息	13,562.46	2,199,064.86
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	239,122,725.46	889,487,829.48
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2014年12月31日	2013年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	50,464,382.30
应付赎回款	1,253,471.96	-
应付管理人报酬	414,428.98	-
应付托管费	69,071.53	175,817.88
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,180,056.47	2,310,517.86
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	76,000.00	176,000.00
负债合计	3,993,028.94	53,126,718.04
所有者权益:		
实收基金	235,493,342.00	869,304,088.98
未分配利润	-363,645.48	-32,942,977.54
所有者权益合计	235,129,696.52	836,361,111.44
负债和所有者权益总计	239,122,725.46	889,487,829.48

注：报告截止日2014年12月31日，基金份额净值0.998元，基金份额总额235,493,342.00份。

7.2 利润表

会计主体：融通通泽灵活配置混合型证券投资基金

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	上年度可比期间 2013年8月30日(基金合 同生效日)至2013年12月 31日
一、收入	74,552,874.85	-27,399,047.31
1. 利息收入	7,104,017.86	7,564,905.55
其中：存款利息收入	3,668,856.01	2,838,866.63
债券利息收入	2,165,234.50	1,698,691.51
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,269,927.35	3,027,347.41
其他利息收入	-	-
2. 投资收益	70,822,067.90	-48,875,286.94
其中：股票投资收益	69,272,569.70	-48,875,286.94
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-876,850.67	-
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	2,426,348.87	-
3. 公允价值变动收益	-3,373,234.92	13,909,484.20
4. 汇兑收益	-	-
5. 其他收入	24.01	1,849.88
减：二、费用	22,501,690.71	5,543,930.23
1. 管理人报酬	2,696,312.71	-
2. 托管费	1,792,211.62	711,575.23
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	17,622,892.13	4,651,634.00
5. 利息支出	2,661.65	-
其中：卖出回购金融资产支出	2,661.65	-
6. 其他费用	387,612.60	180,721.00
三、利润总额	52,051,184.14	-32,942,977.54
减：所得税费用	-	-
四、净利润	52,051,184.14	-32,942,977.54

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通通泽灵活配置混合型证券投资基金

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)	869,304,088.98	-32,942,977.54	836,361,111.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	52,051,184.14	52,051,184.14
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-633,810,746.98	-217,952.12	-634,028,699.10
其中: 1. 基金申购款	252,744.52	-6,065.84	246,678.68
2. 基金赎回款	-634,063,491.50	-211,886.28	-634,275,377.78
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-19,253,899.96	-19,253,899.96
五、期末所有者权益(基金净值)	235,493,342.00	-363,645.48	235,129,696.52
项目	上年度可比期间 2013年8月30日(基金合同生效日)至2013年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	869,304,088.98	-	869,304,088.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-32,942,977.54	-32,942,977.54
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-	-	-
其中: 1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	869,304,088.98	-32,942,977.54	836,361,111.44

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:

孟朝霞

基金管理人负责人

颜锡廉

主管会计工作负责人

刘美丽

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

7.4.1.1 会计政策变更的说明

财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》、《企业会计准则第33号——合并财务报表》以及《企业会计准则第37号——金融工具列报》，要求除《企业会计准则第37号——金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外，其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

本基金本期未发生会计估计变更。

7.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需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”)	基金管理人的股东、基金代销机构
日兴资产管理有限公司	基金管理人的股东
深圳市融通资本财富管理有限公司	基金管理人的子公司
融通国际资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

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8月30日(基金合同生效日)至 2013年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
新时代证券	2,676,610,515.35	23.13%	405,333,169.20	12.59%

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	2,436,787.22	23.53%	531,098.64	24.39%
关联方名称	上年度可比期间 2013年8月30日至2013年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
新时代证券	369,013.28	12.77%	266,629.29	11.54%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。权证交易不计佣金。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.4.2 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8月30日(基金合同生效日) 至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,696,312.71	-
其中：支付销售机构的客户维护费	1,295,112.32	-

注：本基金在转型前未收取管理费。本基金在转型后，支付基金管理人融通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值1.50% / 当年天数。

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8月30日(基金合同生效日) 至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,792,211.62	711,575.23

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.4.3 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。

7.4.4.4.2 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8月30日(基金合同生效日)至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	50,750,487.82	1,253,817.32	98,768,810.21	482,989.43

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金本报告期及上年度可比期间均未买入管理人、托管人的控股股东在承销期内担任副主承销商或分销商所承销的证券；

2、本基金本报告期及上年度可比期间均未买入管理人、托管人的主要股东（非控股）在承销期内承销的证券。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项的说明。

7.4.5 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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	182,573,714.38	76.35
	其中:股票	182,573,714.38	76.35
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	55,428,389.52	23.18
7	其他各项资产	1,120,621.56	0.47
8	合计	239,122,725.46	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	27,045,000.00	11.50
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	26,399,465.10	11.23
J	金融业	129,129,249.28	54.92
K	房地产业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	182,573,714.38	77.65

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	600837	海通证券	1,000,000	24,060,000.00	10.23
2	600577	精达股份	3,000,000	21,270,000.00	9.05
3	600030	中信证券	600,000	20,340,000.00	8.65
4	600016	民生银行	1,599,931	17,407,249.28	7.40
5	600036	招商银行	1,000,000	16,590,000.00	7.06
6	601166	兴业银行	1,000,000	16,500,000.00	7.02
7	600570	恒生电子	299,979	16,426,850.04	6.99
8	601998	中信银行	1,600,000	13,024,000.00	5.54
9	000712	锦龙股份	450,000	12,240,000.00	5.21
10	002657	中科金财	209,994	9,972,615.06	4.24

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人融通基金管理有限公司网站(<http://www.rtfund.com>)的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600030	中信证券	122,836,693.93	14.69
2	300104	乐视网	104,381,299.18	12.48
3	002219	恒康医疗	92,134,895.94	11.02
4	600028	中国石化	86,939,467.21	10.39
5	300124	汇川技术	84,236,819.65	10.07
6	002410	广联达	81,563,170.37	9.75
7	000002	万科A	81,535,674.24	9.75
8	600587	新华医疗	80,950,035.60	9.68
9	300058	蓝色光标	77,081,745.22	9.22
10	600588	用友软件	74,115,872.46	8.86
11	000024	招商地产	73,643,978.94	8.81
12	600570	恒生电子	66,971,880.41	8.01
13	300024	机器人	66,806,415.01	7.99
14	000541	佛山照明	65,567,976.59	7.84
15	600577	精达股份	65,342,285.81	7.81
16	601318	中国平安	65,255,733.01	7.80
17	002594	比亚迪	63,280,189.98	7.57
18	300005	探路者	63,111,610.04	7.55
19	601166	兴业银行	62,156,055.58	7.43
20	600728	佳都科技	57,759,477.39	6.91
21	000547	闽福发A	56,928,272.64	6.81
22	300212	易华录	55,820,276.71	6.67
23	002475	立讯精密	54,335,023.25	6.50
24	600196	复星医药	53,417,479.76	6.39
25	300043	互动娱乐	52,765,928.89	6.31
26	600109	国金证券	52,675,941.75	6.30
27	601888	中国国旅	51,888,439.56	6.20
28	600837	海通证券	51,045,199.95	6.10
29	600703	三安光电	49,889,376.56	5.97
30	600594	益佰制药	48,959,482.38	5.85
31	300144	宋城演艺	47,807,443.89	5.72

32	600060	海信电器	46,941,114.69	5.61
33	600446	金证股份	45,716,263.99	5.47
34	600812	华北制药	45,600,385.71	5.45
35	002657	中科金财	45,422,786.77	5.43
36	300017	网宿科技	43,625,932.42	5.22
37	002065	东华软件	43,082,835.13	5.15
38	600999	招商证券	42,426,860.60	5.07
39	300298	三诺生物	42,416,506.67	5.07
40	601718	际华集团	42,266,545.50	5.05
41	600016	民生银行	37,217,322.81	4.45
42	002174	游族网络	36,000,751.20	4.30
43	300059	东方财富	35,772,522.98	4.28
44	600585	海螺水泥	35,748,886.24	4.27
45	002551	尚荣医疗	35,049,211.52	4.19
46	600340	华夏幸福	33,946,043.62	4.06
47	002117	东港股份	33,734,708.69	4.03
48	600690	青岛海尔	33,398,097.61	3.99
49	600862	南通科技	32,824,664.36	3.92
50	600315	上海家化	32,733,474.43	3.91
51	002522	浙江众成	32,674,956.86	3.91
52	600547	山东黄金	31,848,948.04	3.81
53	603366	日出东方	31,386,841.23	3.75
54	000400	许继电气	31,325,605.74	3.75
55	002321	华英农业	30,895,868.63	3.69
56	600036	招商银行	30,637,930.19	3.66
57	002241	歌尔声学	29,560,468.16	3.53
58	300326	凯利泰	29,553,234.24	3.53
59	002353	杰瑞股份	29,465,110.61	3.52
60	002236	大华股份	29,247,321.07	3.50
61	002415	海康威视	29,197,602.70	3.49
62	300003	乐普医疗	28,433,367.95	3.40
63	000712	锦龙股份	28,093,876.05	3.36
64	002385	大北农	27,854,604.44	3.33
65	000750	国海证券	27,650,160.22	3.31
66	002368	太极股份	27,536,437.18	3.29
67	002008	大族激光	26,846,523.72	3.21

68	002701	奥瑞金	26,763,412.17	3.20
69	002051	中工国际	26,745,204.98	3.20
70	300164	通源石油	26,563,145.95	3.18
71	000963	华东医药	26,525,883.76	3.17
72	002631	德尔家居	26,191,956.77	3.13
73	300070	碧水源	25,871,684.61	3.09
74	600276	恒瑞医药	25,088,313.88	3.00
75	601800	中国交建	24,827,847.09	2.97
76	300273	和佳股份	24,609,871.49	2.94
77	002678	珠江钢琴	24,334,970.95	2.91
78	002390	信邦制药	23,399,264.98	2.80
79	000996	中国中期	23,291,466.63	2.78
80	000895	双汇发展	23,080,940.41	2.76
81	600161	天坛生物	23,013,011.33	2.75
82	000333	美的集团	22,315,354.13	2.67
83	600525	长园集团	22,153,010.22	2.65
84	600000	浦发银行	21,980,000.00	2.63
85	600582	天地科技	21,804,582.36	2.61
86	601998	中信银行	21,762,751.92	2.60
87	002153	石基信息	21,653,136.35	2.59
88	000651	格力电器	21,392,518.77	2.56
89	002437	誉衡药业	20,519,810.95	2.45
90	300026	红日药业	20,399,458.84	2.44
91	000521	美菱电器	20,051,324.15	2.40
92	000666	经纬纺机	19,757,631.64	2.36
93	601333	广深铁路	19,730,695.82	2.36
94	300006	莱美药业	19,674,689.06	2.35
95	300165	天瑞仪器	19,461,699.51	2.33
96	002292	奥飞动漫	19,423,018.76	2.32
97	300015	爱尔眼科	19,123,923.48	2.29
98	600406	国电南瑞	18,859,744.56	2.25
99	603077	和邦股份	18,664,721.56	2.23
100	300020	银江股份	18,584,807.33	2.22
101	300110	华仁药业	18,219,845.66	2.18
102	002518	科士达	18,039,685.73	2.16
103	000518	四环生物	17,479,544.10	2.09

104	600195	中牧股份	17,407,573.78	2.08
105	000597	东北制药	17,270,101.41	2.06
106	300072	三聚环保	16,969,957.82	2.03
107	300133	华策影视	16,952,305.77	2.03
108	600835	上海机电	16,910,796.76	2.02

注：“买入金额”是指买入股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600030	中信证券	130,272,272.63	15.58
2	600587	新华医疗	119,101,386.08	14.24
3	002219	恒康医疗	117,066,978.54	14.00
4	601318	中国平安	100,738,300.72	12.04
5	300104	乐视网	98,808,340.94	11.81
6	600028	中国石化	84,817,248.17	10.14
7	000002	万科A	83,654,671.62	10.00
8	002410	广联达	83,316,517.18	9.96
9	300058	蓝色光标	75,554,020.86	9.03
10	300124	汇川技术	75,512,110.95	9.03
11	600588	用友软件	74,897,177.71	8.96
12	000024	招商地产	72,343,309.66	8.65
13	300024	机器人	68,219,053.50	8.16
14	002594	比亚迪	63,429,313.41	7.58
15	000541	佛山照明	63,111,007.68	7.55
16	300017	网宿科技	63,055,178.17	7.54
17	601166	兴业银行	60,306,549.95	7.21
18	002631	德尔家居	59,940,550.94	7.17
19	300005	探路者	59,563,402.22	7.12
20	000547	闽福发A	58,830,165.94	7.03
21	600446	金证股份	56,384,964.79	6.74
22	600570	恒生电子	54,918,265.94	6.57
23	002475	立讯精密	54,851,971.56	6.56
24	600728	佳都科技	53,766,320.77	6.43
25	300043	互动娱乐	52,946,037.94	6.33
26	601888	中国国旅	52,247,538.60	6.25
27	600999	招商证券	52,062,425.99	6.22

28	600109	国金证券	51,455,199.38	6.15
29	002657	中科金财	51,429,511.53	6.15
30	002236	大华股份	50,727,163.94	6.07
31	600196	复星医药	50,714,948.13	6.06
32	600812	华北制药	50,377,787.40	6.02
33	600060	海信电器	50,203,287.72	6.00
34	600703	三安光电	49,798,959.09	5.95
35	600577	精达股份	48,666,556.24	5.82
36	300212	易华录	47,426,855.78	5.67
37	300144	宋城演艺	45,748,014.18	5.47
38	600594	益佰制药	45,437,297.22	5.43
39	601718	际华集团	45,221,201.82	5.41
40	600837	海通证券	43,030,907.21	5.15
41	002065	东华软件	42,335,382.87	5.06
42	300070	碧水源	42,274,390.47	5.05
43	002241	歌尔声学	39,268,067.73	4.70
44	600276	恒瑞医药	38,518,914.12	4.61
45	600036	招商银行	38,225,167.25	4.57
46	600340	华夏幸福	36,578,204.02	4.37
47	002174	游族网络	36,487,610.60	4.36
48	300059	东方财富	36,424,475.67	4.36
49	002522	浙江众成	35,568,104.50	4.25
50	600585	海螺水泥	35,431,812.40	4.24
51	600315	上海家化	34,960,829.97	4.18
52	002321	华英农业	34,597,610.83	4.14
53	000750	国海证券	33,611,325.91	4.02
54	002117	东港股份	33,299,058.84	3.98
55	002551	尚荣医疗	33,237,354.77	3.97
56	603366	日出东方	33,123,041.41	3.96
57	600862	南通科技	32,688,507.99	3.91
58	600547	山东黄金	32,564,399.77	3.89
59	000049	德赛电池	32,296,046.78	3.86
60	300298	三诺生物	31,966,694.42	3.82
61	000400	许继电气	30,825,493.47	3.69
62	002008	大族激光	28,285,965.29	3.38
63	002368	太极股份	28,260,547.13	3.38
64	600690	青岛海尔	28,169,717.75	3.37
65	002415	海康威视	28,145,944.76	3.37

66	002051	中工国际	28,048,361.76	3.35
67	002353	杰瑞股份	27,917,503.11	3.34
68	300003	乐普医疗	27,875,895.02	3.33
69	601800	中国交建	26,884,482.10	3.21
70	002701	奥瑞金	26,703,306.17	3.19
71	600535	天士力	26,207,722.93	3.13
72	600161	天坛生物	25,964,707.20	3.10
73	300326	凯利泰	25,755,000.09	3.08
74	000963	华东医药	25,654,425.73	3.07
75	002385	大北农	25,653,861.07	3.07
76	300164	通源石油	25,496,987.78	3.05
77	600000	浦发银行	25,146,000.00	3.01
78	000996	中国中期	25,048,599.28	2.99
79	300273	和佳股份	24,686,027.71	2.95
80	002678	珠江钢琴	24,647,704.96	2.95
81	002437	誉衡药业	23,877,406.78	2.85
82	000333	美的集团	22,340,324.82	2.67
83	000895	双汇发展	22,173,078.70	2.65
84	601333	广深铁路	21,734,005.39	2.60
85	603077	和邦股份	21,446,255.70	2.56
86	000651	格力电器	21,361,340.45	2.55
87	300253	卫宁软件	21,352,595.62	2.55
88	600016	民生银行	21,310,000.00	2.55
89	002153	石基信息	21,138,775.74	2.53
90	600582	天地科技	20,987,405.69	2.51
91	000521	美菱电器	20,731,006.36	2.48
92	002390	信邦制药	20,403,788.26	2.44
93	002292	奥飞动漫	20,403,294.91	2.44
94	300015	爱尔眼科	20,029,397.81	2.39
95	000712	锦龙股份	19,810,625.09	2.37
96	600525	长园集团	19,801,345.85	2.37
97	000661	长春高新	19,736,297.17	2.36
98	000666	经纬纺机	19,291,025.06	2.31
99	600406	国电南瑞	18,643,342.02	2.23
100	300026	红日药业	18,624,269.85	2.23
101	002279	久其软件	17,873,340.04	2.14
102	000597	东北制药	17,785,286.49	2.13
103	300006	莱美药业	17,547,627.25	2.10

104	300020	银江股份	17,521,240.83	2.09
105	000518	四环生物	17,511,329.72	2.09
106	600195	中牧股份	17,446,007.58	2.09
107	601988	中国银行	16,960,764.00	2.03
108	000090	天健集团	16,951,312.00	2.03

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	5,648,734,540.60
卖出股票收入（成交）总额	5,922,406,658.41

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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	1,107,059.10
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,562.46
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,120,621.56

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
2,304	102,210.65	0.00	0.00%	235,493,342.00	100.00%

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	406,406.51	0.1726%

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（2014年9月2日）基金份额总额	869,304,088.98
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	252,744.52
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	634,063,491.50
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	235,493,342.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金份额持有人大会于2014年8月27日审议通过了《关于融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金转型及相关事项的议案》，持有人大会决议由基金管理人报中国证监会备案生效。自2014年8月27日起，基金名称变更为“融通通泽灵活配置混合型证券投资基金”，由《融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《融通通泽灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利义务关系以《融通通泽灵活配置混合型证券投资基金基金合同》为准。

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

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。

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

本基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内无诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期未发生改变。

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)，本年度应支付的审计费为人民币76,000.00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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
新时代证券	1	2,676,610,515.35	23.13%	2,436,787.22	23.53%	-
中信证券	1	1,402,329,577.10	12.12%	1,240,921.74	11.98%	-
长江证券	1	1,338,122,282.53	11.57%	1,184,107.43	11.43%	-
光大证券	1	904,429,766.28	7.82%	800,332.63	7.73%	-
中信建投	1	789,334,411.96	6.82%	718,604.26	6.94%	-
安信证券	2	763,660,499.14	6.60%	680,294.78	6.57%	-
中金公司	1	709,664,728.22	6.13%	627,984.16	6.06%	-
申银万国	1	705,474,203.23	6.10%	642,263.23	6.20%	-
平安证券	2	695,403,094.20	6.01%	617,637.33	5.96%	-
广州证券	2	502,469,065.25	4.34%	447,078.90	4.32%	-
海通证券	1	485,165,362.16	4.19%	429,322.50	4.15%	-
长城证券	1	331,521,778.28	2.87%	293,364.72	2.83%	-
华泰证券	1	129,107,188.83	1.12%	114,247.10	1.10%	-
恒泰证券	1	74,477,812.60	0.64%	67,804.72	0.65%	-
渤海证券	1	37,548,556.28	0.32%	34,184.23	0.33%	-
中航证券	1	24,793,515.30	0.21%	22,571.97	0.22%	-
中山证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	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) 财力雄厚，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，并能为本基金提供全面的信息服；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

2、选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的程序包括以下四个步骤：

- (1) 券商服务评价;
- (2) 拟定租用对象。由研究部根据以上评价结果拟定备选的券商;
- (3) 上报批准。研究部将拟定租用对象上报分管副总经理批准;
- (4) 签约。在获得批准后,按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

3、交易单元变更情况

本基金本报告期新增光大证券交易单元一个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
新时代证券	-	-	4,980,000,000.00	78.98%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	119,059,849.87	100.00%	20,000,000.00	0.32%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	1,305,000,000.00	20.70%	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-

融通基金管理有限公司

二〇一五年三月二十六日