

融通内需驱动混合型证券投资基金
(原融通内需驱动股票型证券投资基金)

2015 年半年度报告

2015 年 6 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

送出日期：2015 年 8 月 25 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。本半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。

根据本基金的管理人融通基金管理有限公司于 2015 年 8 月 7 日发布的《融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金更名的公告》，经与基金托管人协商，并报中国证监会备案，自 2015 年 8 月 7 日起，“融通内需驱动股票型证券投资基金”更名为“融通内需驱动混合型证券投资基金”，本次基金更名不改变基金投资范围，对基金份额持有人利益无实质性不利影响。所以，本半年度报告中的相关基金名称及基金简称均以变更后的新的基金名称和基金简称进行表述，请投资者知晓。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据融通内需驱动混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)基金合同规定，于 2015 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介	5
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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
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.....	10
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	14
§ 7 投资组合报告	28
7.1 期末基金资产组合情况.....	28
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	29
7.3 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.....	29
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	31
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
7.6 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.....	39
7.7 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.....	39
7.8 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.....	39
7.9 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.....	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.12 投资组合报告附注.....	40

§ 8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
8.3 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.....	41
§ 9 开放式基金份额变动	41
§ 10 重大事件揭示	42
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
10.2 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.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	42
10.8 其他重大事件.....	43
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	44
§ 12 备查文件目录	45

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	融通内需驱动混合型证券投资基金
基金简称	融通内需驱动混合
基金主代码	161611
前端交易代码	161611
后端交易代码	161661
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 4 月 22 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	414,560,231.51 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于由国内投资需求和消费需求所驱动的优势企业，分享中国经济增长及增长方式转变所带来的收益，实现基金资产可持续的稳定增值。
投资策略	本基金重点投资于由国内投资需求和消费需求所驱动的优势企业，根据经济演进的规律和产业变迁的路径，“自上而下”确定资产配置与行业配置比例，在行业配置下“自下而上”精选个股。本基金股票资产主要投资于治理规范、经营稳健、财务良好和盈利能力强的内需驱动型的优秀公司，但是，只有满足“规范、独特、简单、成长”特性的龙头公司才有可能成为我们的核心资产，对这部分资产，我们将长期持有，充分分享中国经济长期高速增长和企业做大做强所带来的巨大收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中信标普全债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于高风险高收益的基金品种，其收益和风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		融通基金管理有限公司	中国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	高峰	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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金半年度报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	135,302,778.54
本期利润	34,876,800.43
加权平均基金份额本期利润	0.1041
本期加权平均净值利润率	8.41%
本期基金份额净值增长率	44.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	157,148,241.67
期末可供分配基金份额利润	0.3791
期末基金资产净值	571,708,473.18
期末基金份额净值	1.379
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	53.57%

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）。

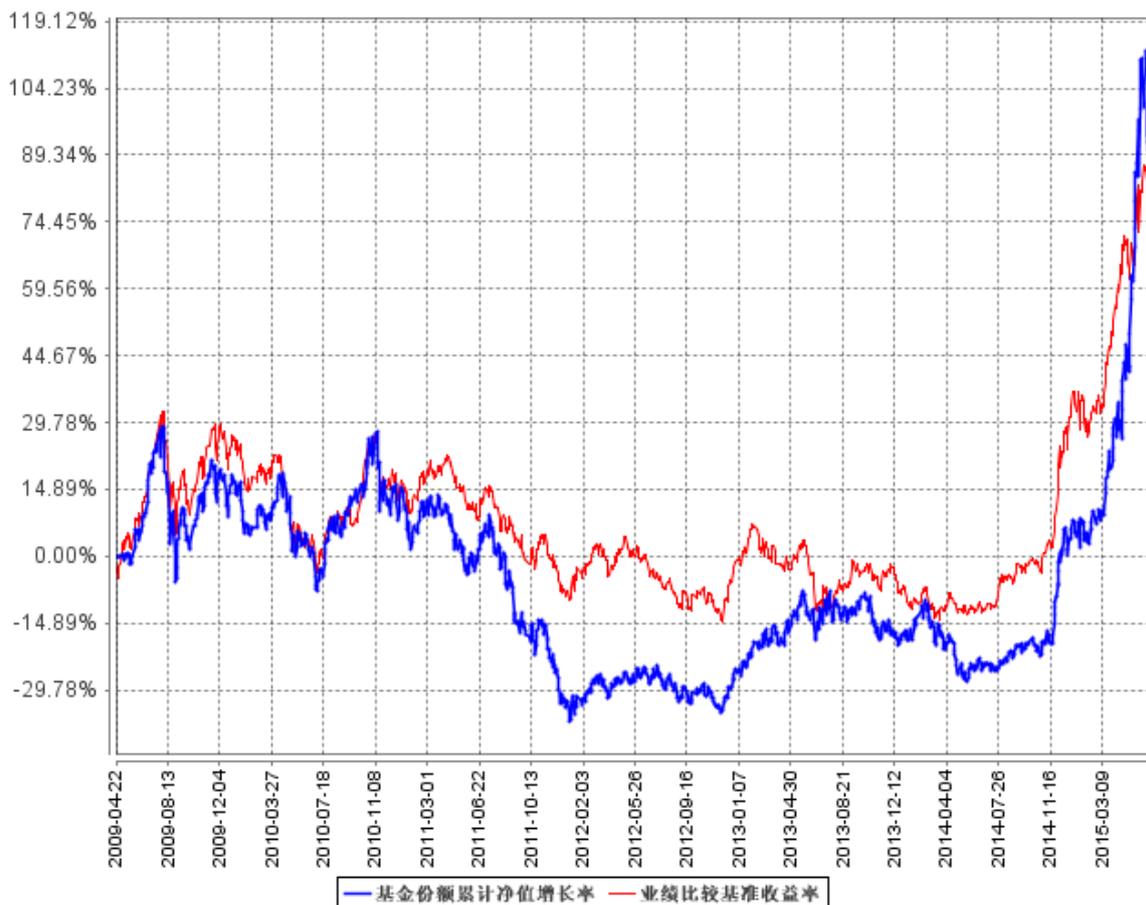
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	-18.11%	3.96%	-5.90%	2.80%	-12.21%	1.16%
过去三个月	26.63%	3.22%	8.87%	2.09%	17.76%	1.13%
过去六个月	44.85%	2.56%	21.77%	1.82%	23.08%	0.74%
过去一年	101.90%	1.94%	82.39%	1.48%	19.51%	0.46%
过去三年	110.86%	1.53%	67.83%	1.20%	43.03%	0.33%
自基金合同生效起至今	53.57%	1.56%	62.32%	1.23%	-8.75%	0.33%

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



§ 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 2015 年 6 月 30 日，公司管理的基金共有三十一只：一只封闭式基金，即融通通乾封闭基金；三十只开放式基金，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、融通动力先锋混合基金、融通领先成长混合基金（LOF）、融通内需驱动混合基金、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、融通医疗保健行业混合基金、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、融通月月添利定期开放债券基金、融通健康产业灵活配置混合基金、融通转型三动力灵活配置混合基金、融通互联网传媒灵活配置混合基金、融通新区新经济灵活配置混合基金、融通通鑫灵活配置混合基金和融通新能源灵活配置混合基金。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		
杨博琳	本基金、融通动力先锋混合、融通新区新经济灵活配置混合的基金经理	2015 年 4 月 28 日	-	5	金融学硕士，毕业于北京大学光华管理学院，具有基金从业资格。2010 年 7 月至 2014 年 12 月在华夏基金管理有限公司投资研究部工作，历任研究员、TMT 研究组长。2014 年 12 月加入融通基金管理有限公司。
周珺	本基金的基金经理	2012 年 1 月 5 日	2015 年 4 月 28 日	7	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：任职日期和离任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。

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》等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，本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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本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

2015年上半年，在A股历史上是足以载入史册的半年，对于每一位投资人以及基金管理人都将终身难忘，短短半年时间，经历了过去几年才能经历的牛熊转换，经验在市场面前变得微不足道，年轻的A股在杠杆面前变得异常脆弱，将人性的贪婪和软弱放大的淋漓尽致。

上半年前5个月，市场走出了以创业板引领的代表转型和创新的火热牛市，各种“互联网+”概念涌现，其中互联网金融，互联网医疗，车联网，汽车后市场等概念尤为火热。在报告期内，基金管理人将仓位主要配置在以下几个成长方向：1) 互联网医疗、汽车后市场；2) 传统行业积极拥抱转型的公司；3) 类次新股中的优质公司，包括质地较好的次新股以及重组复牌后的股票。

进入6月份，尤其是6月中下旬，大盘以近乎惨烈的方式急速下挫，杀跌的主力也是前期表现较好的中小市值成长股，虽然在下跌过程中也对仓位做了一定的控制，但是回撤依然较大。

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 44.85%，同期业绩比较基准收益率为 21.77%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们不悲观，在经历过这段惨烈的杀跌之后，很多股票进入价值区间，本基金将继续坚持成长投资风格，积极寻找投资机会，市场在经历了这一波快速去杠杆之后，将变得相对理性，因此，选股的重要性凸显。同时，在下半年的投资中，将更加重视回撤的风险，尽量避免基金净值的大幅波动。

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

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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内需驱动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，融通内需驱动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内需驱动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，融通内需驱动混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半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内需驱动混合型证券投资基金 2015 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：融通内需驱动混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	177,851,985.32	101,818,713.90
结算备付金		4,443,019.33	7,459,615.58
存出保证金		627,334.37	738,048.66
交易性金融资产	6.4.7.2	461,729,090.23	292,312,771.32
其中：股票投资		461,729,090.23	272,298,771.32
基金投资		-	-
债券投资		-	20,014,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-

应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	25,582.32	426,818.12
应收股利		-	-
应收申购款		3,890,650.14	232,085.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		648,567,661.71	402,988,053.20
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		34,685,589.72	14,257,206.15
应付赎回款		38,581,771.08	2,864,480.78
应付管理人报酬		890,010.14	482,154.07
应付托管费		148,335.01	80,359.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,233,473.09	4,231,148.37
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	320,009.49	315,676.99
负债合计		76,859,188.53	22,231,025.37
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	414,560,231.51	399,964,876.31
未分配利润	6.4.7.10	157,148,241.67	-19,207,848.48
所有者权益合计		571,708,473.18	380,757,027.83
负债和所有者权益总计		648,567,661.71	402,988,053.20

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.379 元，基金份额总额 414,560,231.51 份。

6.2 利润表

会计主体：融通内需驱动混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至 2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年6月30日
一、收入		47,765,345.87	-23,459,404.70

1. 利息收入		514,410.17	723,962.01
其中：存款利息收入	6.4.7.11	260,656.75	315,332.19
债券利息收入		253,753.42	395,972.60
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	12,657.22
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		147,389,012.47	-11,981,489.48
其中：股票投资收益	6.4.7.12	146,431,205.37	-13,082,530.10
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	47,820.00	-4,510.00
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	909,987.10	1,105,550.62
3. 公允价值变动收益	6.4.7.17	-100,425,978.11	-12,372,296.47
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	6.4.7.18	287,901.34	170,419.24
减：二、费用		12,888,545.44	10,624,775.23
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,076,874.77	3,346,624.74
2. 托管费	6.4.10.2.2	512,812.49	557,770.83
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	9,158,308.72	6,584,110.02
5. 利息支出		2,122.26	-
其中：卖出回购金融资产支出		2,122.26	-
6. 其他费用	6.4.7.20	138,427.20	136,269.64
三、利润总额		34,876,800.43	-34,084,179.93
减：所得税费用		-	-
四、净利润		34,876,800.43	-34,084,179.93

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通内需驱动混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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）	399,964,876.31	-19,207,848.48	380,757,027.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	34,876,800.43	34,876,800.43

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	14,595,355.20	141,479,289.72	156,074,644.92
其中：1. 基金申购款	376,988,272.33	263,032,153.78	640,020,426.11
2. 基金赎回款	-362,392,917.13	-121,552,864.06	-483,945,781.19
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)	414,560,231.51	157,148,241.67	571,708,473.18
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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)	745,583,356.24	-190,617,070.03	554,966,286.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-34,084,179.93	-34,084,179.93
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-214,837,742.20	56,423,014.63	-158,414,727.57
其中：1. 基金申购款	11,729,090.13	-3,177,683.05	8,551,407.08
2. 基金赎回款	-226,566,832.33	59,600,697.68	-166,966,134.65
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)	530,745,614.04	-168,278,235.33	362,467,378.71

注：后附 6.4 报表附注为本财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

融通内需驱动混合型证券投资基金(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”)证监许可[2008]第 1284 号《关于核准融通内需驱动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《融通内需驱动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 2,954,933,272.95 元，业经普华永道中天会计师事务所

有限公司验字(2009)第 70 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《融通内需驱动股票型证券投资基金基金合同》于 2009 年 4 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,955,174,216.52 份基金份额,其中认购资金利息折合 240,943.57 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(以下简称“中国工商银行”)。

根据 2014 年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金动作管理办法》第三十条的相关规定,经于基金托管人协商,并报中国证监会备案,自 2015 年 8 月 7 日起,本基金名称由原“融通内需驱动股票型证券投资基金基金”更名为“融通内需驱动混合型证券投资基金基金”,本次基金更名不改变基金投资范围,对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

详见本基金管理人 2015 年 8 月 7 日在指定信息披露媒体上刊登的《融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金更名的公告》。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通内需驱动混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行和上市的各类股票、权证、债券、资产支持证券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合比例为:股票资产占基金净资产的比例为 60%-95%;债券与其它金融工具的投资比例范围为 5%-40%,其中现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的 5%,权证投资比例范围为基金净资产的 0%-3%。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 \times 80%+中信标普全债指数收益率 \times 20%。

6.4.2 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《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>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《融通内需驱动混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年半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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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

本基金本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告一致，会计估计与最近一期年度报告不一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 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，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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
活期存款	177,851,985.32
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	177,851,985.32

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	539,796,102.74	461,729,090.23	-78,067,012.51
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	539,796,102.74	461,729,090.23	-78,067,012.51

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末各项买入返售金融资产余额均为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	23,528.79
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	1,799.46
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	254.07
合计	25,582.32

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	2,233,148.09
银行间市场应付交易费用	325.00
合计	2,233,473.09

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付赎回费	131,077.76
预提费用	188,931.73
合计	320,009.49

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	399,964,876.31	399,964,876.31
本期申购	376,988,272.33	376,988,272.33
本期赎回	-362,392,917.13	-362,392,917.13
本期末	414,560,231.51	414,560,231.51

6.4.7.10 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	47,822,854.83	-67,030,703.31	-19,207,848.48
本期利润	135,302,778.54	-100,425,978.11	34,876,800.43
本期基金份额交易产生的变动数	81,990,666.66	59,488,623.06	141,479,289.72
其中：基金申购款	232,909,039.16	30,123,114.62	263,032,153.78
基金赎回款	-150,918,372.50	29,365,508.44	-121,552,864.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	265,116,300.03	-107,968,058.36	157,148,241.67

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	169,379.28
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	46,890.99
其他	44,386.48
合计	260,656.75

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	2,992,381,779.08
减：卖出股票成本总额	2,845,950,573.71
买卖股票差价收入	146,431,205.37

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	20,683,332.05
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	19,978,060.00
减：应收利息总额	657,452.05
买卖债券差价收入	47,820.00

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益/损失。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具投资产生收益/损失。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	909,987.10
基金投资产生的股利收益	-
合计	909,987.10

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-100,425,978.11
——股票投资	-100,390,038.11
——债券投资	-35,940.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-100,425,978.11

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	250,355.38
转换费收入	37,545.96
合计	287,901.34

注：本基金的赎回费率按持有期限递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	9,158,108.72
银行间市场交易费用	200.00
合计	9,158,308.72

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	99,178.95
银行汇划费	495.47
债券账户维护费	9,000.00
合计	138,427.20

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：上述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,076,874.77	3,346,624.74
其中：支付销售机构的客户维护费	821,480.81	1,084,265.80

注：1、支付基金管理人融通基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

2、客户维护费是基金管理人与基金销售机构约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的费用，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	512,812.49	557,770.83

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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.3 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无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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，基金管理人的主要股东及其控制的机构未持有本基金份额。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年6月30日		2014年1月1日至2014年6月30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	177,851,985.32	169,379.28	102,300,649.81	276,353.02

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。

6.4.10.6 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）在承销期承销的股票。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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/增发而流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
603898	好莱客	2015-06-15	重大事项	109.47	-	-	424,511	48,030,822.39	46,471,219.17	-
002044	江苏三友	2015-06-18	重大事项	44.80	2015-07-01	49.50	511,091	25,355,843.93	22,896,876.80	-
002665	首航节能	2015-06-30	重大事项	29.34	2015-07-01	30.00	943,250	38,287,634.73	27,674,955.00	-
300163	先锋新材	2015-06-30	重大事项	31.54	-	-	1,150,877	44,921,397.40	36,298,660.58	-
300195	长荣股份	2015-06-26	重大事项	28.36	2015-08-24	28.76	1,114,600	38,216,601.10	31,610,056.00	-
300419	浩丰科技	2015-04-24	重大事项	228.45	2015-08-14	216.41	20,000	3,768,712.00	4,569,000.00	-
300431	暴风科技	2015-06-11	重大事项	211.45	2015-07-13	276.80	112,200	30,760,027.00	23,724,690.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。

6.4.13.2 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，与该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 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2014 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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 6.4.12 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，其余金融资产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。

本基金所持有的全部金融负债的合约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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	177,851,985.32	-	-	-	177,851,985.32
结算备付金	4,443,019.33	-	-	-	4,443,019.33
存出保证金	627,334.37	-	-	-	627,334.37
交易性金融资产	-	-	-	461,729,090.23	461,729,090.23
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	25,582.32	25,582.32
应收申购款	1,547,726.03	-	-	2,342,924.11	3,890,650.14
资产总计	184,470,065.05	-	-	464,097,596.66	648,567,661.71
负债					
应付证券清算款	-	-	-	34,685,589.72	34,685,589.72
应付赎回款	-	-	-	38,581,771.08	38,581,771.08
应付管理人报酬	-	-	-	890,010.14	890,010.14
应付托管费	-	-	-	148,335.01	148,335.01
应付交易费用	-	-	-	2,233,473.09	2,233,473.09
其他负债	-	-	-	320,009.49	320,009.49
负债总计	-	-	-	76,859,188.53	76,859,188.53
利率敏感性缺口	184,470,065.05	-	-	387,238,408.13	571,708,473.18
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	101,818,713.90	-	-	-	101,818,713.90
结算备付金	7,459,615.58	-	-	-	7,459,615.58
存出保证金	738,048.66	-	-	-	738,048.66
交易性金融资产	20,014,000.00	-	-	272,298,771.32	292,312,771.32
应收利息	-	-	-	426,818.12	426,818.12
应收申购款	124,659.01	-	-	107,426.61	232,085.62
资产总计	130,155,037.15	-	-	272,833,016.05	402,988,053.20
负债					

应付证券清算款	-	-	-	14,257,206.15	14,257,206.15
应付赎回款	-	-	-	2,864,480.78	2,864,480.78
应付管理人报酬	-	-	-	482,154.07	482,154.07
应付托管费	-	-	-	80,359.01	80,359.01
应付交易费用	-	-	-	4,231,148.37	4,231,148.37
其他负债	-	-	-	315,676.99	315,676.99
负债总计	-	-	-	22,231,025.37	22,231,025.37
利率敏感性缺口	130,155,037.15	-	-	250,601,990.68	380,757,027.83

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2014 年 12 月 31 日：5.26%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2014 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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，采用“自上而下”的策略，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净资产的 60%-95%，债券与其他金融工具的投资比例范围为 5%-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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 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	461,729,090.23	80.76	272,298,771.32	71.52
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	461,729,090.23	80.76	272,298,771.32	71.52

6.4.13.4.3.2 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 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上升 5%	24,583,464.35	13,516,874.49
沪深 300 指数下降 5%	-24,583,464.35	-13,516,874.49	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	461,729,090.23	71.19
	其中：股票	461,729,090.23	71.19
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	182,295,004.65	28.11

7	其他各项资产	4,543,566.83	0.70
8	合计	648,567,661.71	100.00

7.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	356,662,787.76	62.39
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	396,105.36	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	5,364,647.00	0.94
H	住宿和餐饮业	5,390,828.35	0.94
I	信息传输、软件和信息技术服务业	72,882,273.36	12.75
J	金融业	-	-
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	2,192,702.40	0.38
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	10,987,746.00	1.92
R	文化、体育和娱乐业	7,852,000.00	1.37
S	综合	-	-
	合计	461,729,090.23	80.76

7.3 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	603898	好莱客	424,511	46,471,219.17	8.13
2	002612	朗姿股份	549,980	37,096,151.00	6.49
3	300163	先锋新材	1,150,877	36,298,660.58	6.35
4	300195	长荣股份	1,114,600	31,610,056.00	5.53

5	300174	元力股份	1,066,600	29,139,512.00	5.10
6	002665	首航节能	943,250	27,674,955.00	4.84
7	300431	暴风科技	112,200	23,724,690.00	4.15
8	300046	台基股份	978,774	23,010,976.74	4.02
9	002044	江苏三友	511,091	22,896,876.80	4.00
10	300075	数字政通	601,748	22,679,882.12	3.97
11	300078	中瑞思创	272,600	18,465,924.00	3.23
12	300120	经纬电材	658,200	16,928,904.00	2.96
13	002085	万丰奥威	272,261	16,681,431.47	2.92
14	002532	新界泵业	599,942	11,788,860.30	2.06
15	300244	迪安诊断	130,900	10,987,746.00	1.92
16	300448	浩云科技	112,100	10,827,739.00	1.89
17	002175	广陆数测	160,591	8,912,800.50	1.56
18	002488	金固股份	250,000	8,120,000.00	1.42
19	002699	美盛文化	200,000	7,852,000.00	1.37
20	002279	久其软件	136,986	7,328,751.00	1.28
21	002601	佰利联	133,200	6,060,600.00	1.06
22	600480	凌云股份	248,800	5,861,728.00	1.03
23	601636	旗滨集团	523,000	5,611,790.00	0.98
24	000524	岭南控股	248,999	5,390,828.35	0.94
25	002357	富临运业	224,700	5,350,107.00	0.94
26	300419	浩丰科技	20,000	4,569,000.00	0.80
27	300325	德威新材	168,600	2,950,500.00	0.52
28	300312	邦讯技术	53,300	2,472,054.00	0.43
29	300332	天壕节能	87,012	2,192,702.40	0.38
30	300104	乐视网	14,124	731,058.24	0.13
31	300218	安利股份	41,400	642,114.00	0.11
32	300098	高新兴	16,000	466,240.00	0.08
33	300022	吉峰农机	29,940	395,507.40	0.07
34	002599	盛通股份	5,500	209,330.00	0.04
35	300246	宝莱特	2,989	131,516.00	0.02
36	002394	联发股份	5,300	82,044.00	0.01
37	300302	同有科技	1,980	70,191.00	0.01
38	600029	南方航空	1,000	14,540.00	0.00
39	300235	方直科技	400	12,668.00	0.00
40	300293	蓝英装备	351	10,140.39	0.00
41	600127	金健米业	404	3,995.56	0.00
42	603008	喜临门	83	1,563.72	0.00
43	300344	太空板业	49	698.25	0.00

44	000705	浙江震元	36	597.96	0.00
45	002366	丹甫股份	6	440.28	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	601628	中国人寿	74,277,404.43	19.51
2	601318	中国平安	58,388,622.86	15.33
3	603898	好莱客	52,378,549.39	13.76
4	002279	久其软件	52,356,004.50	13.75
5	002612	朗姿股份	51,969,904.15	13.65
6	300163	先锋新材	44,921,397.40	11.80
7	000024	招商地产	40,783,145.04	10.71
8	601166	兴业银行	39,519,008.74	10.38
9	300431	暴风科技	38,796,756.00	10.19
10	002665	首航节能	38,287,634.73	10.06
11	300195	长荣股份	38,216,601.10	10.04
12	002085	万丰奥威	37,286,565.44	9.79
13	300075	数字政通	36,967,105.14	9.71
14	600376	首开股份	35,367,893.39	9.29
15	300174	元力股份	34,765,516.19	9.13
16	300046	台基股份	33,544,290.80	8.81
17	002175	东方网络	33,020,716.60	8.67
18	300295	三六五网	32,313,511.90	8.49
19	300293	蓝英装备	29,421,746.77	7.73
20	300246	宝莱特	26,681,555.00	7.01
21	002044	江苏三友	25,355,843.93	6.66
22	600570	恒生电子	24,965,913.14	6.56
23	002366	丹甫股份	23,794,752.27	6.25
24	600000	浦发银行	23,512,516.58	6.18
25	000732	泰禾集团	22,885,536.46	6.01
26	300120	经纬电材	22,860,920.20	6.00
27	601988	中国银行	22,700,491.00	5.96
28	002657	中科金财	22,600,741.37	5.94

29	300104	乐视网	22,581,062.70	5.93
30	300059	东方财富	22,519,674.34	5.91
31	300367	东方网力	22,432,478.09	5.89
32	600030	中信证券	22,327,291.00	5.86
33	300244	迪安诊断	21,337,228.29	5.60
34	300337	银邦股份	20,996,109.80	5.51
35	600536	中国软件	20,415,259.96	5.36
36	601601	中国太保	19,454,086.13	5.11
37	002721	金一文化	19,431,892.99	5.10
38	002009	天奇股份	18,421,915.85	4.84
39	300312	邦讯技术	18,255,459.00	4.79
40	300078	中瑞思创	17,615,669.50	4.63
41	600837	海通证券	17,417,233.83	4.57
42	601989	中国重工	17,382,200.98	4.57
43	000046	泛海控股	16,821,604.32	4.42
44	002707	众信旅游	16,280,145.70	4.28
45	601633	长城汽车	16,013,820.20	4.21
46	002394	联发股份	15,839,885.14	4.16
47	300168	万达信息	15,504,199.92	4.07
48	002236	大华股份	15,411,576.42	4.05
49	002373	千方科技	15,382,944.86	4.04
50	300235	方直科技	14,965,516.90	3.93
51	000975	银泰资源	14,897,171.46	3.91
52	300380	安硕信息	14,432,477.55	3.79
53	300448	浩云科技	14,319,434.60	3.76
54	000997	新大陆	14,042,497.56	3.69
55	002475	立讯精密	13,666,074.77	3.59
56	300218	安利股份	13,561,422.58	3.56
57	600436	片仔癀	13,522,433.17	3.55
58	600115	东方航空	13,511,005.14	3.55
59	600029	南方航空	13,388,402.00	3.52
60	002415	海康威视	13,353,067.00	3.51
61	002532	新界泵业	13,156,459.60	3.46
62	002540	亚太科技	13,127,836.51	3.45
63	600280	中央商场	13,062,871.90	3.43
64	600587	新华医疗	13,045,754.35	3.43

65	002699	美盛文化	12,911,362.00	3.39
66	000712	锦龙股份	12,701,387.02	3.34
67	601233	桐昆股份	12,670,415.99	3.33
68	600435	北方导航	12,660,603.40	3.33
69	002339	积成电子	12,570,792.03	3.30
70	601021	春秋航空	12,563,261.00	3.30
71	002170	芭田股份	12,554,207.36	3.30
72	300207	欣旺达	12,526,945.20	3.29
73	002065	东华软件	12,510,754.22	3.29
74	000776	广发证券	12,295,969.17	3.23
75	000002	万科A	12,131,441.09	3.19
76	600104	上汽集团	12,023,119.00	3.16
77	000651	格力电器	11,879,317.49	3.12
78	300022	吉峰农机	11,666,656.13	3.06
79	300332	天壕节能	11,443,810.95	3.01
80	601818	光大银行	11,385,567.99	2.99
81	002153	石基信息	11,330,683.00	2.98
82	600576	万好万家	11,096,290.53	2.91
83	601699	潞安环能	11,016,408.00	2.89
84	000333	美的集团	11,005,068.22	2.89
85	300344	太空板业	11,002,622.63	2.89
86	300370	安控科技	10,887,169.21	2.86
87	600240	华业地产	10,798,201.00	2.84
88	300018	中元华电	10,709,358.34	2.81
89	600048	保利地产	10,627,083.88	2.79
90	300347	泰格医药	10,619,815.43	2.79
91	300146	汤臣倍健	10,614,097.63	2.79
92	002642	荣之联	10,539,675.70	2.77
93	300063	天龙集团	10,523,727.45	2.76
94	002331	皖通科技	10,516,652.30	2.76
95	600682	南京新百	10,348,233.00	2.72
96	300147	香雪制药	10,311,365.52	2.71
97	000669	金鸿能源	10,285,108.32	2.70
98	600005	武钢股份	10,196,300.00	2.68
99	600999	招商证券	10,174,753.80	2.67
100	000060	中金岭南	10,088,094.05	2.65

101	002154	报喜鸟	10,068,511.43	2.64
102	002325	洪涛股份	10,004,134.06	2.63
103	300019	硅宝科技	9,991,552.88	2.62
104	600571	信雅达	9,920,940.75	2.61
105	002318	久立特材	9,916,163.15	2.60
106	000791	甘肃电投	9,905,888.90	2.60
107	300253	卫宁软件	9,869,844.00	2.59
108	300094	国联水产	9,825,354.09	2.58
109	000807	云铝股份	9,815,173.20	2.58
110	600315	上海家化	9,781,902.65	2.57
111	300115	长盈精密	9,735,541.15	2.56
112	002344	海宁皮城	9,729,877.97	2.56
113	300137	先河环保	9,718,539.42	2.55
114	002195	二三四五	9,690,900.00	2.55
115	300024	机器人	9,687,758.17	2.54
116	601299	中国北车	9,669,128.50	2.54
117	600348	阳泉煤业	9,572,677.04	2.51
118	000625	长安汽车	9,258,898.44	2.43
119	000858	五粮液	9,228,071.21	2.42
120	601006	大秦铁路	9,221,938.08	2.42
121	300239	东宝生物	9,211,741.34	2.42
122	002151	北斗星通	9,147,341.29	2.40
123	002432	九安医疗	9,060,699.00	2.38
124	002177	御银股份	9,053,910.50	2.38
125	600885	宏发股份	9,045,191.50	2.38
126	601139	深圳燃气	8,931,316.87	2.35
127	601328	交通银行	8,890,837.00	2.34
128	002267	陕天然气	8,836,707.85	2.32
129	002353	杰瑞股份	8,700,981.32	2.29
130	000705	浙江震元	8,694,456.25	2.28
131	300206	理邦仪器	8,621,269.64	2.26
132	300032	金龙机电	8,570,154.94	2.25
133	300353	东土科技	8,552,878.15	2.25
134	300290	荣科科技	8,466,735.00	2.22
135	300178	腾邦国际	8,436,514.17	2.22
136	600127	金健米业	8,435,131.99	2.22

137	603019	中科曙光	8,307,944.00	2.18
138	600998	九州通	8,303,429.46	2.18
139	002488	金固股份	8,281,061.14	2.17
140	002230	科大讯飞	8,205,558.90	2.16
141	603008	喜临门	8,189,538.06	2.15
142	002563	森马服饰	8,172,613.00	2.15
143	002280	联络互动	8,045,080.00	2.11
144	600271	航天信息	8,035,017.22	2.11
145	600208	新潮中宝	7,964,540.00	2.09
146	300273	和佳股份	7,906,033.76	2.08
147	300013	新宁物流	7,808,705.00	2.05
148	600466	迪康药业	7,803,473.99	2.05

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。

7.4.2 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	601628	中国人寿	94,172,528.11	24.73
2	601318	中国平安	83,485,602.21	21.93
3	601166	兴业银行	61,821,058.21	16.24
4	600030	中信证券	47,125,865.89	12.38
5	600376	首开股份	44,083,503.57	11.58
6	002279	久其软件	41,860,952.80	10.99
7	000024	招商地产	38,853,275.05	10.20
8	300367	东方网力	38,628,336.09	10.15
9	000002	万科 A	32,019,763.74	8.41
10	300295	三六五网	31,399,601.95	8.25
11	600048	保利地产	28,760,760.65	7.55
12	002721	金一文化	27,702,292.62	7.28
13	600570	恒生电子	26,734,732.48	7.02
14	300337	银邦股份	26,458,119.75	6.95
15	300293	蓝英装备	26,433,048.59	6.94
16	002009	天奇股份	26,294,633.91	6.91
17	002085	万丰奥威	25,511,890.96	6.70
18	300246	宝莱特	25,360,416.10	6.66
19	002657	中科金财	24,945,046.29	6.55

20	601988	中国银行	22,722,122.39	5.97
21	000732	泰禾集团	22,691,540.11	5.96
22	600536	中国软件	22,672,472.04	5.95
23	600000	浦发银行	22,560,703.47	5.93
24	300059	东方财富	21,809,852.18	5.73
25	000503	海虹控股	20,673,508.64	5.43
26	002175	东方网络	20,061,043.36	5.27
27	300104	乐视网	19,874,794.08	5.22
28	002366	丹甫股份	19,762,362.00	5.19
29	002540	亚太科技	19,595,116.16	5.15
30	300168	万达信息	19,190,111.03	5.04
31	600280	中央商场	18,486,196.92	4.86
32	002236	大华股份	18,114,691.14	4.76
33	300094	国联水产	18,106,913.20	4.76
34	601601	中国太保	17,668,564.48	4.64
35	002612	朗姿股份	17,400,248.00	4.57
36	002373	千方科技	17,051,226.83	4.48
37	601989	中国重工	16,744,733.00	4.40
38	000046	泛海控股	16,572,432.34	4.35
39	000997	新大陆	16,495,069.32	4.33
40	600587	新华医疗	16,492,632.64	4.33
41	600837	海通证券	16,167,847.60	4.25
42	601633	长城汽车	16,037,173.14	4.21
43	601299	中国北车	15,921,576.36	4.18
44	600576	万好万家	15,837,572.80	4.16
45	002170	芭田股份	15,509,887.52	4.07
46	300018	中元华电	15,359,627.48	4.03
47	601021	春秋航空	15,040,996.00	3.95
48	002331	皖通科技	14,766,845.90	3.88
49	002394	联发股份	14,660,186.08	3.85
50	000975	银泰资源	14,617,020.18	3.84
51	300312	邦讯技术	14,596,082.01	3.83
52	300370	安控科技	14,265,141.49	3.75
53	600270	外运发展	14,185,958.38	3.73
54	002475	立讯精密	14,047,372.93	3.69
55	600436	片仔癀	14,026,835.44	3.68
56	002325	洪涛股份	13,939,157.92	3.66
57	002415	海康威视	13,667,675.74	3.59

58	300115	长盈精密	13,634,033.42	3.58
59	600115	东方航空	13,571,103.50	3.56
60	600435	北方导航	13,536,833.21	3.56
61	300207	欣旺达	13,437,648.12	3.53
62	002707	众信旅游	13,372,490.99	3.51
63	002065	东华软件	13,302,642.50	3.49
64	300344	太空板业	12,874,415.50	3.38
65	300431	暴风科技	12,795,523.00	3.36
66	600682	南京新百	12,648,424.45	3.32
67	601233	桐昆股份	12,526,272.38	3.29
68	600029	南方航空	12,442,836.00	3.27
69	600168	武汉控股	12,341,580.54	3.24
70	002177	御银股份	12,095,455.82	3.18
71	300063	天龙集团	12,070,145.00	3.17
72	002339	积成电子	11,986,767.36	3.15
73	002153	石基信息	11,923,408.20	3.13
74	300380	安硕信息	11,896,102.00	3.12
75	000712	锦龙股份	11,777,824.08	3.09
76	300019	硅宝科技	11,740,220.77	3.08
77	000651	格力电器	11,739,288.36	3.08
78	000776	广发证券	11,724,463.85	3.08
79	600104	上汽集团	11,681,701.96	3.07
80	300218	安利股份	11,601,970.93	3.05
81	600015	华夏银行	11,534,409.00	3.03
82	300235	方直科技	11,529,163.79	3.03
83	300253	卫宁软件	11,474,791.94	3.01
84	300290	荣科科技	11,409,549.00	3.00
85	300022	吉峰农机	11,141,567.47	2.93
86	300244	迪安诊断	10,882,102.69	2.86
87	300147	香雪制药	10,827,855.08	2.84
88	601818	光大银行	10,821,000.00	2.84
89	601699	潞安环能	10,784,903.98	2.83
90	600315	上海家化	10,778,104.82	2.83
91	002642	荣之联	10,663,208.50	2.80
92	000157	中联重科	10,656,835.00	2.80
93	300024	机器人	10,613,968.00	2.79
94	002344	海宁皮城	10,600,455.80	2.78
95	300239	东宝生物	10,586,253.00	2.78

96	000333	美的集团	10,532,228.17	2.77
97	300146	汤臣倍健	10,504,385.93	2.76
98	600240	华业地产	10,412,301.16	2.73
99	002154	报喜鸟	10,409,701.00	2.73
100	002195	二三四五	10,346,525.82	2.72
101	600005	武钢股份	10,269,782.90	2.70
102	300137	先河环保	10,213,571.39	2.68
103	300347	泰格医药	10,198,546.40	2.68
104	000060	中金岭南	10,142,860.88	2.66
105	600571	信雅达	10,089,162.59	2.65
106	000807	云铝股份	10,066,362.67	2.64
107	000012	南玻A	10,024,814.86	2.63
108	000791	甘肃电投	9,951,086.93	2.61
109	002267	陕天然气	9,929,999.28	2.61
110	002318	久立特材	9,860,527.41	2.59
111	002151	北斗星通	9,807,855.83	2.58
112	600466	迪康药业	9,760,218.92	2.56
113	000669	金鸿能源	9,706,512.00	2.55
114	600998	九州通	9,530,331.21	2.50
115	600348	阳泉煤业	9,449,988.46	2.48
116	300353	东土科技	9,440,387.48	2.48
117	600999	招商证券	9,369,961.62	2.46
118	300013	新宁物流	9,290,408.86	2.44
119	600885	宏发股份	9,266,634.52	2.43
120	601006	大秦铁路	9,264,708.63	2.43
121	300032	金龙机电	9,143,563.45	2.40
122	600703	三安光电	9,106,509.62	2.39
123	002432	九安医疗	9,003,202.40	2.36
124	601139	深圳燃气	8,916,212.55	2.34
125	300178	腾邦国际	8,817,287.99	2.32
126	002280	联络互动	8,802,996.01	2.31
127	002563	森马服饰	8,736,699.13	2.29
128	000705	浙江震元	8,711,173.86	2.29
129	000858	五粮液	8,682,288.00	2.28
130	601328	交通银行	8,675,500.00	2.28
131	000625	长安汽车	8,615,173.47	2.26
132	002353	杰瑞股份	8,562,056.90	2.25
133	002142	宁波银行	8,426,013.60	2.21

134	600271	航天信息	8,394,584.53	2.20
135	603555	贵人鸟	8,379,196.46	2.20
136	603019	中科曙光	8,351,539.02	2.19
137	300302	同有科技	8,292,789.68	2.18
138	300206	理邦仪器	8,172,291.51	2.15
139	300240	飞力达	8,151,115.70	2.14
140	002230	科大讯飞	8,143,323.44	2.14
141	300109	新开源	8,100,604.08	2.13
142	300273	和佳股份	8,096,992.90	2.13
143	000150	宜华健康	7,995,619.40	2.10
144	600511	国药股份	7,959,599.56	2.09
145	600309	万华化学	7,834,521.93	2.06
146	600129	太极集团	7,826,524.40	2.06
147	600127	金健米业	7,792,148.00	2.05
148	603008	喜临门	7,777,818.69	2.04
149	002397	梦洁家纺	7,718,411.40	2.03
150	001696	宗申动力	7,660,488.00	2.01

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。

7.4.3 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	3,135,770,930.73
卖出股票收入（成交）总额	2,992,381,779.08

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。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	627,334.37
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	25,582.32
5	应收申购款	3,890,650.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,543,566.83

7.12.4 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。

7.12.5 期末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	603898	好莱客	46,471,219.17	8.13	重大事项披露
2	300163	先锋新材	36,298,660.58	6.35	重大事项披露
3	300195	长荣股份	31,610,056.00	5.53	重大事项披露
4	002665	首航节能	27,674,955.00	4.84	重大事项披露
5	300431	暴风科技	23,724,690.00	4.15	重大事项披露
6	002044	江苏三友	22,896,876.80	4.00	重大资产重组停牌

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
14,826	27,961.70	498,571.82	0.12%	414,061,659.69	99.88%

8.2 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	362,787.25	0.0875%

8.3 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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2009年4月22日)基金份额总额	2,955,174,216.52
本报告期期初基金份额总额	399,964,876.31
本报告期基金总申购份额	376,988,272.33
减:本报告期基金总赎回份额	362,392,917.13
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	414,560,231.51

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

自 2015 年 4 月 28 日起，周珺先生不再担任本基金的基金经理，由杨博琳先生担任本基金的基金经理。具体内容请参阅 2015 年 4 月 28 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。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变更。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 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。

10.6 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基金租用证券公司交易单元的有关情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
广发证券		12,445,563,708.29	39.91%	2,164,082.54	39.51%	-
长江证券		21,692,585,330.72	27.62%	1,523,462.58	27.81%	-

川财证券	2	819,039,331.36	13.37%	736,842.52	13.45%	-
方正证券	1	658,345,037.74	10.74%	599,353.47	10.94%	-
中投证券	1	512,619,301.70	8.36%	453,617.69	8.28%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中山证券	2	-	-	-	-	-

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、本报告期内基金租用交易单元无变更，原申银万国证券吸收合并宏源证券后变更为申万宏源证券。

10.7.2 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。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	披露日期
----	------	--------	------

1	融通基金管理有限公司关于旗下部分基金在工商银行开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、 证券日报、管理人网站	2015-01-19
2	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金面向养老金客户实施特定申购费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、 证券日报、管理人网站	2015-02-02
3	关于旗下部分开放式基金参加恒丰银行股份有限公司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	2015-02-17
4	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	2015-03-31
5	融通基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、 证券日报、管理人网站	2015-03-28
6	融通基金关于新增上海利得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	2015-04-20
7	关于融通旗下部分开放式基金参加银河证券基金申购（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	2015-04-20
8	融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金在上海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	2015-04-27
9	融通内需驱动混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、 证券日报、管理人网站	2015-04-28
10	融通基金管理有限公司关于旗下部分基金在招商银行开通定投及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、 证券日报、管理人网站	2015-05-27
11	融通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加一路财富（北京）信息科技有限公司网上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	2015-05-28
12	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加农业银行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	2015-05-30
13	融通基金关于新增国金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	2015-06-15
14	融通基金关于新增中国国际金融股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、 证券日报、管理人网站	2015-06-26

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

1. 根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》，经与托管银行、会计师事务所协商一致，自 2015 年 3 月 27 日起本基金对持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值，详见本管理人 2015 年 3 月 28 日公告。

2. 本基金的基金管理人融通基金管理有限公司 2015 年 7 月 25 日刊登高管人员变更公告，田德军先生因个人原因辞去公司董事长职务，由高峰先生担任公司董事长职务。

具体内容请参阅 2015 年 7 月 25 日刊登在指定信息披露媒体上刊登的《融通基金管理有限公司关于高管人员变更的公告》。

§ 12 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准融通内需驱动混合型证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通内需驱动混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通内需驱动混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通内需驱动混合型证券投资基金招募说明书》及其定期更新
- (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批准成立批件、营业执照、公司章程
- (七) 基金托管人中国工商银行业务资格批件和营业执照

基金管理人、基金托管人处

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
<http://www.rtfund.com> 查阅。