

融通通泽灵活配置混合型证券投资基金 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。

融通通泽灵活配置混合型证券投资基金是由“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，详情请参阅 2014 年 8 月 29 日的《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决议生效的公告》。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据融通通泽灵活配置混合型证券投资基金基金合同规定，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

<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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</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	6
3.3 其他指标	错误! 未定义书签。
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
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	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
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
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>11</b>
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	15
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>30</b>
7.1 期末基金资产组合情况	30
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	31
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	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	33
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	34
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	35
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	35
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	35
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	35
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	35
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	36

7.12 投资组合报告附注 .....	36
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>37</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	37
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	37
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 .....	37
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>37</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>37</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	37
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 .....	37
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	38
10.4 基金投资策略的改变 .....	38
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	38
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 .....	38
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	38
10.8 其他重大事件 .....	40
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>错误! 未定义书签。</b>
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>41</b>
12.1 备查文件目录 .....	42
12.2 存放地点 .....	42
12.3 查阅方式 .....	42

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	融通通泽灵活配置混合型证券投资基金
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	10,459,922,591.90 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
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》、《证券时报》
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、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	199,495,952.38
本期利润	211,232,120.64
加权平均基金份额本期利润	0.0454
本期加权平均净值利润率	4.75%
本期基金份额净值增长率	-2.71%
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	-306,453,715.94
期末可供分配基金份额利润	-0.0293
期末基金资产净值	10,153,468,875.96
期末基金份额净值	0.971
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	4.82%

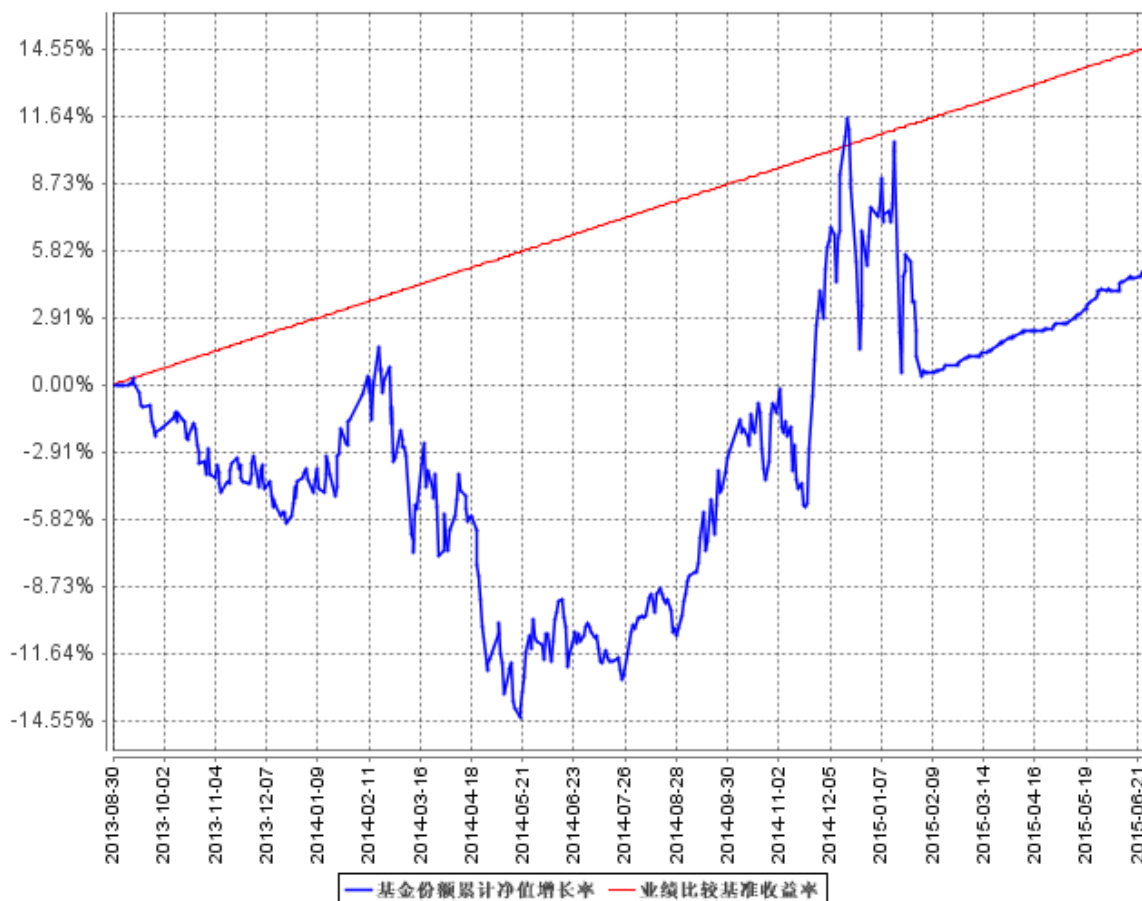
### 3.2 基金净值表现

#### 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	0.62%	0.10%	0.66%	0.00%	-0.04%	0.10%
过去三个月	2.75%	0.08%	1.99%	0.00%	0.76%	0.08%
过去六个月	-2.71%	0.88%	3.97%	0.00%	-6.68%	0.88%
过去一年	17.64%	1.14%	8.00%	0.00%	9.64%	1.14%
自基金合同生效起至今	4.82%	1.02%	14.71%	0.00%	-9.89%	1.02%

### 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：1、本基金转型后的基金合同生效日为 2014 年 9 月 2 日。

2、本基金转型后的建仓期为转型后合同生效日起 6 个月。截至本报告期末，各项资产配置比例符合合同约定。

## § 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		
余志勇	本基金、融通通泰保本、融通通鑫灵活配置混合的基金经理	2015-2-25	-	14	金融学硕士，具有基金从业资格。先后任职于湖北省农业厅、闽发证券，2004 年加入招商证券股份有限公司研究发展中心，从事房地产行业研究工作。2007 年加入融通基金管理有限公司，曾任研究部行业研究员、行业组长。
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	2014-09-02	2015-03-28	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。
--	--	--	--	--	--------------------

注：任职日期和离任日期均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工作的时间为计算标准。

## 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》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

考虑到本基金设计的目的是为了保持基金净值增长率的平稳性，因此在基本配置上本基

金上半年逐步降低了仓位，用更多的资金积极参与了新股的发行，取得了相对稳定的收益；同时也将富余的资金适当的配置在了高流动性债券和回购类资产，以求获得较好的基础性收益。今年下半年经济下行压力较大，流动性补充需求迫切，定向宽松仍是首要选项，这对股票和债券市场基本面都还是形成支撑，所以本基金还是继续延续之前的投资思路，追求较为稳定的投资回报。

#### 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-2.71%，业绩比较基准增长率为 3.97%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场经历 6 月底至 7 月初剧烈的回调后，杠杆资金的逐步出清和市场信心的恢复都需要一定的时间。随着市场风险偏好的降低，投资人对业绩的增长和估值安全边际的要求会更加苛刻，本基金将根据市场环境的变化和国家相关政策的调整，更加严格地控制风险以求获得稳定的回报。

#### 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通泽灵活配置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：融通通泽灵活配置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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	7,893,476,545.81	50,750,487.82
结算备付金		40,123,603.83	4,677,901.70
存出保证金		272,827.10	1,107,059.10

交易性金融资产	6.4.7.2	581,846,342.85	182,573,714.38
其中：股票投资		129,432,342.85	182,573,714.38
基金投资		-	-
债券投资		452,414,000.00	-
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	1,631,003,459.50	-
应收证券清算款		33,225,387.29	-
应收利息	6.4.7.5	10,623,887.24	13,562.46
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		10,190,572,053.62	239,122,725.46
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年6月30日</b>	<b>上年度末 2014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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		21,848,638.39	1,253,471.96
应付管理人报酬		12,524,193.06	414,428.98
应付托管费		2,087,365.53	69,071.53
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	404,343.21	2,180,056.47
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	238,637.47	76,000.00
负债合计		37,103,177.66	3,993,028.94
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	10,459,922,591.90	235,493,342.00
未分配利润	6.4.7.10	-306,453,715.94	-363,645.48
所有者权益合计		10,153,468,875.96	235,129,696.52
负债和所有者权益总计		10,190,572,053.62	239,122,725.46

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.971 元，基金份额总额 10,459,922,591.90 份。

## 6.2 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：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
<b>一、收入</b>		250,574,750.38	-49,591,469.48
1. 利息收入		41,353,978.98	5,292,483.41
其中：存款利息收入	6.4.7.11	20,336,652.53	2,975,957.77
债券利息收入		3,416,507.45	2,104,837.25
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		17,600,819.00	211,688.39
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		196,932,852.29	-51,892,916.20
其中：股票投资收益	6.4.7.12	196,397,679.07	-52,538,008.98
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	325,946.64	-868,750.67
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	209,226.58	1,513,843.45
3. 公允价值变动收益	6.4.7.17	11,736,168.26	-2,991,036.69
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	6.4.7.18	551,750.85	-
<b>减：二、费用</b>		39,342,629.74	11,862,434.68
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	32,484,729.77	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,414,121.67	1,007,890.78
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,245,826.64	10,643,073.81
5. 利息支出		22,525.60	2,661.65
其中：卖出回购金融资产支出		22,525.60	2,661.65
6. 其他费用	6.4.7.20	175,426.06	208,808.44
<b>三、利润总额</b>		211,232,120.64	-61,453,904.16
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润</b>		211,232,120.64	-61,453,904.16

## 6.3 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：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)	235,493,342.00	-363,645.48	235,129,696.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	211,232,120.64	211,232,120.64
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	10,224,429,249.90	-517,322,191.10	9,707,107,058.80
其中：1. 基金申购款	10,558,961,573.02	-532,526,773.09	10,026,434,799.93
2. 基金赎回款	-334,532,323.12	15,204,581.99	-319,327,741.13
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	10,459,922,591.90	-306,453,715.94	10,153,468,875.96
	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
项目	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)	-	-61,453,904.16	-61,453,904.16
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	-94,396,881.70	774,907,207.28

报表附注为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)(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[2013]944号《关于核准融通通泽一年目标触发式灵活配置混合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》负责公开募集。本基金为契约型证券投资基金,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 868,810,282.67 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2013)第 556 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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》于 2013 年 8 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 869,304,088.98 份基金份额,其中认购资金利息折合 493,806.31 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《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》的有关规定,本基金成立后封闭运作,不开放申购、赎回。在基金的累计份额净值触发“连续 3 个工作日不低于 1.10 元”的提前到期条件后,本基金提前到期,自触发提前到期条件后的次一工作日起,基金进入变现及清算程序。本基金最长封闭期为 1 年,即最长封闭期为基金合同生效日起至基金合同生效日年对日的期间,若本基金在最长封闭期内未触发提前到期条件,则本基金在最长封闭期结束后的次一工作日起进入变现及清算程序。

根据本基金的基金管理人融通基金管理有限公司 2014 年 7 月 26 日的《融通基金管理有限公司关于召开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(通讯方式)的公告》,本基金的基金管理人经与本基金的基金托管人中国工商银行协商一致,决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会(以下简称“本次大会”),审议本基金展期及转型等相关事宜,将本基金变更为融通通泽灵活配置混合型证券投资基金。本次大会的权益登记日为 2014 年 7 月 24 日,投票表决时间为自 2014 年 7 月 26 日起至 2014 年 8 月 26 日 17:00 时止。根据本次会议投票表决结果审议通过的《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》,本基金视以下两种情况进行转型安排:1) 融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金到期日(2014 年 9 月 1 日)前,基金份额累计净值连续 3 个工作日达到 1.10 元,融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金于上述“连续 3 个工作日”的下一日起转型为融通通泽灵活配置混合型证券投资基金,开放申购和赎回。2) 融通通泽一年目标触发式

灵活配置混合型证券投资基金到期日前，基金份额累计净值未连续 3 个工作日达到 1.10 元，则融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金于到期日的下一日(2014 年 9 月 2 日)起转型为融通通泽灵活配置混合型证券投资基金，转型后仅开放赎回，暂不开放申购。

截至融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金到期日(2014 年 9 月 1 日)止，本基金基金份额累计净值未连续 3 个工作日达到 1.10 元，本基金自 2014 年 9 月 2 日起转型为融通通泽灵活配置混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通通泽灵活配置混合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，包括国内依法公开发行上市交易的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、一级市场新股或增发的股票、权证、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金及到期日在一年以内的政府债券，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金业绩比较基准为年化收益率 8%。

#### 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》和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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金的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 6 月 30 日期间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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 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。
- (2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票的差价收入,股权的股息、红利收入及其他收入,暂不征收企业所得税。
- (3) 自 2013 年 1 月 1 日起,对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时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	1,793,476,545.81
定期存款	6,100,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	6,100,000,000.00
其他存款	-
合计：	7,893,476,545.81

#### 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	107,967,435.31	129,432,342.85	21,464,907.54	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	451,606,490.00	452,414,000.00	807,510.00
	合计	451,606,490.00	452,414,000.00	807,510.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	559,573,925.31	581,846,342.85	22,272,417.54	

#### 6.4.7.3 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。

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_交易所	200,000,000.00	-
买入返售证券_银行间	1,431,003,459.50	-
合计	1,631,003,459.50	-

##### 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所取得的债券。

#### 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	99,492.44
应收定期存款利息	2,308,333.34
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	16,250.04
应收债券利息	7,430,542.47
应收买入返售证券利息	769,158.43
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	110.52
合计	10,623,887.24

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 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	339,032.85
银行间市场应付交易费用	65,310.36
合计	404,343.21

#### 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
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	25,770.70
预提费用	212,866.77
合计	238,637.47

#### 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	235,493,342.00	235,493,342.00
本期申购	10,558,961,573.02	10,558,961,573.02
本期赎回（以“-”号填列）	-334,532,323.12	-334,532,323.12
本期末	10,459,922,591.90	10,459,922,591.90

## 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	-1,423,290.83	1,059,645.35	-363,645.48
本期利润	199,495,952.38	11,736,168.26	211,232,120.64
本期基金份额交易产生的变动数	-174,982,401.71	-342,339,789.39	-517,322,191.10
其中：基金申购款	-179,410,760.56	-353,116,012.53	-532,526,773.09
基金赎回款	4,428,358.85	10,776,223.14	15,204,581.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,090,259.84	-329,543,975.78	-306,453,715.94

## 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	3,060,795.88
定期存款利息收入	16,773,622.22
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	158,855.42
其他	343,379.01
合计	20,336,652.53

## 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	526,916,162.93
减：卖出股票成本总额	330,518,483.86
买卖股票差价收入	196,397,679.07

## 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	137,275,065.75
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	131,487,605.05
减：应收利息总额	5,461,514.06
买卖债券差价收入	325,946.64

## 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	209,226.58
基金投资产生的股利收益	-
合计	209,226.58

## 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	11,736,168.26
——股票投资	10,928,658.26
——债券投资	807,510.00
——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	11,736,168.26

## 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	418,476.05
转换费收入	133,274.80
合计	551,750.85

## 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	1,243,151.64
银行间市场交易费用	2,675.00
合计	1,245,826.64

## 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	37,697.82	
信息披露费	-	
公告费	99,178.95	
其他	200.00	
银行费用	20,349.29	
债券帐户维护费	18,000.00	
合计	175,426.06	

## 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，本基金无需要做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
中国民生银行股份有限公司	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

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。

## 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

## 6.4.10.1.1 股票交易

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	
	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	188,096,403.44	26.59%	1,391,792,666.20	19.72%

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30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	171,240.25	26.79%	171,240.25	50.51%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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	1,267,083.37	20.13%	723,192.21	21.36%

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。

#### 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	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管理费	32,484,729.77	-
其中：支付销售机构的客户维护费	535,241.87	-

##### 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	5,414,121.67	1,007,890.78

#### 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

本基金本报告期未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

本报告期内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，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。

#### 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 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	
	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	1,793,476,545.81	3,060,795.88	88,047,161.27	640,508.50

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。

#### 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

本基金本报告期无利润分配事项。

#### 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300443	金雷风电	2015-4-16	-	新股流通受限	31.94	145.98	65,566	2,094,178.04	9,571,324.68	-
300436	广生堂	2015-4-16	-	新股流通受限	21.47	149.39	47,297	1,015,466.59	7,065,698.83	-



300463	迈克生物	2015-5-21	-	新股流通受限	27.96	87.76	233,333	6,523,990.68	20,477,304.08	-
300487	蓝晓科技	2015-6-24	2015-7-2	新股流通受限	14.83	14.83	10,700	158,681.00	158,681.00	-
603838	四通股份	2015-6-23	2015-7-1	新股流通受限	7.73	7.73	18,119	140,059.87	140,059.87	-
300488	恒峰工具	2015-6-25	2015-7-1	新股流通受限	20.11	20.11	6,734	135,420.74	135,420.74	-
300489	中飞股份	2015-6-24	2015-7-1	新股流通受限	17.56	17.56	7,319	128,521.64	128,521.64	-
300480	光力科技	2015-6-25	2015-7-2	新股流通受限	7.28	7.28	7,263	52,874.64	52,874.64	-

#### 6.4.12.2 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
300467	迅游科技	2015-6-25	股权激励	297.30	2015-7-2	267.57	3,726	125,752.50	1,107,739.80	-
603898	好莱客	2015-6-15	资产重组	109.47	-	-	20,000	2,736,328.00	2,189,400.00	-
002665	首航节能	2015-6-30	重大事项	29.34	2015-7-1	30.00	100,000	4,015,013.00	2,934,000.00	-
300349	金卡股份	2015-6-18	资产重组	44.93	2015-8-19	53.81	150,000	8,178,617.70	6,739,500.00	-

#### 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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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。本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本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在有效时间内为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。

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，在董事会下设立风险控制与审计委员会，主要负责公司运行合规性的监督、核查以及公司内外部审计的沟通、监督和核查工作。委员会对董事会负责；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直接责任人，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；风险管理小组由总经理办公会决定的投资专业人员和金融工程人员组成，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同责任，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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，定期存款存放于具有基金托管资格的中信银行股份有限公司和中国民生银行股份有限公司，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 2015 年 06 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2014 年 12 月 31 日：无）。

#### 6.4.13.3 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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券在证券交易所上市交易，因此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 2015 年 06 月 30 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。

#### 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、结算备付金及存出保证金等。

##### 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	7,893,476,545.81	-	-	-	7,893,476,545.81
结算备付金	40,123,603.83	-	-	-	40,123,603.83
存出保证金	272,827.10	-	-	-	272,827.10
交易性金融资产	452,414,000.00	-	-	129,432,342.85	581,846,342.85
买入返售金融资产	1,631,003,459.50	-	-	-	1,631,003,459.50
应收证券清算款	-	-	-	33,225,387.29	33,225,387.29
应收利息	-	-	-	10,623,887.24	10,623,887.24
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	10,017,290,436.24	-	-	173,281,617.38	10,190,572,053.62
负债					
应付赎回款	-	-	-	21,848,638.39	21,848,638.39
应付管理人报酬	-	-	-	12,524,193.06	12,524,193.06
应付托管费	-	-	-	2,087,365.53	2,087,365.53
应付交易费用	-	-	-	404,343.21	404,343.21
其他负债	-	-	-	238,637.47	238,637.47
负债总计	-	-	-	37,103,177.66	37,103,177.66
利率敏感度缺口	10,017,290,436.24	-	-	136,178,439.72	10,153,468,875.96
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	50,750,487.82	-	-	-	50,750,487.82
结算备付金	4,677,901.70	-	-	-	4,677,901.70
存出保证金	1,107,059.10	-	-	-	1,107,059.10

交易性金融资产				182,573,714.38	182,573,714.38
买入返售金融资产				-	-
应收证券清算款				-	-
应收利息				13,562.46	13,562.46
资产总计	56,535,448.62			182,587,276.84	239,122,725.46
负债					
应付赎回款				1,253,471.96	1,253,471.96
应付管理人报酬				414,428.98	414,428.98
应付托管费				69,071.53	69,071.53
应付交易费用				2,180,056.47	2,180,056.47
其他负债				76,000.00	76,000.00
负债总计				3,993,028.94	3,993,028.94
利率敏感度缺口	56,535,448.62			178,594,247.90	235,129,696.52

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 06 月 30 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 4.46% (2014 年 12 月 31 日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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。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。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，现金或者到期日在一年以内

的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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	129,432,342.85	1.27	182,573,714.38	77.65
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	129,432,342.85	1.27	182,573,714.38	77.65

#### 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 06 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
	1. 沪深 300 指数上升 5%	421,368,958.35	6,230,936.96
2. 沪深 300 指数下降 5%	-421,368,958.35	-6,230,936.96	

#### 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	129,432,342.85	1.27
	其中：股票	129,432,342.85	1.27
2	固定收益投资	452,414,000.00	4.44
	其中：债券	452,414,000.00	4.44
	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	1,631,003,459.50	16.01
	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	7,933,600,149.64	77.85
7	其他各项资产	44,122,101.63	0.43
8	合计	10,190,572,053.62	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	484,279.65	0.00
B	采矿业	1,635,059.25	0.02
C	制造业	91,461,447.78	0.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,842,000.00	0.08
E	建筑业	517,786.92	0.01
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	12,775,963.44	0.13
J	金融业	12,531,380.00	0.12
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	347,952.30	0.00
M	科学研究和技术服务业	823,611.68	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	1,012,861.83	0.01
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	129,432,342.85	1.27
----	----------------	------

### 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	300463	迈克生物	233,333	20,477,304.08	0.20
2	601318	中国平安	150,000	12,291,000.00	0.12
3	300443	金雷风电	65,566	9,571,324.68	0.09
4	300352	北信源	199,901	8,675,703.40	0.09
5	601985	中国核电	600,000	7,842,000.00	0.08
6	300436	广生堂	47,297	7,065,698.83	0.07
7	300349	金卡股份	150,000	6,739,500.00	0.07
8	300425	环能科技	100,000	6,609,000.00	0.07
9	601992	金隅股份	500,000	5,975,000.00	0.06
10	600141	兴发集团	299,910	5,167,449.30	0.05
11	002448	中原内配	375,000	5,126,250.00	0.05
12	603808	歌力思	75,071	4,073,352.46	0.04
13	000969	安泰科技	250,000	3,595,000.00	0.04
14	300198	纳川股份	250,000	3,337,500.00	0.03
15	002665	首航节能	100,000	2,934,000.00	0.03
16	300440	运达科技	40,000	2,866,000.00	0.03
17	603898	好莱客	20,000	2,189,400.00	0.02
18	600305	恒顺醋业	61,488	1,856,322.72	0.02
19	603116	红蜻蜓	65,333	1,831,937.32	0.02
20	603979	金诚信	66,063	1,635,059.25	0.02
21	300485	赛升药业	17,372	1,164,097.72	0.01
22	603589	口子窖	45,168	1,144,557.12	0.01
23	300467	迅游科技	3,726	1,107,739.80	0.01
24	603568	伟明环保	27,501	1,012,861.83	0.01
25	002776	柏堡龙	20,296	823,611.68	0.01
26	002775	文科园林	19,306	517,786.92	0.01
27	002772	众兴菌业	21,381	484,279.65	0.00
28	002773	康弘药业	17,338	411,430.74	0.00
29	002770	科迪乳业	40,555	399,872.30	0.00
30	002768	国恩股份	14,405	362,429.80	0.00
31	002769	普路通	7,710	347,952.30	0.00
32	601211	国泰君安	7,000	240,380.00	0.00
33	300486	东杰智能	16,092	207,104.04	0.00



34	300482	万孚生物	7,942	182,983.68	0.00
35	300487	蓝晓科技	10,700	158,681.00	0.00
36	300483	沃施股份	9,356	153,438.40	0.00
37	300481	濮阳惠成	11,296	148,542.40	0.00
38	603838	四通股份	18,119	140,059.87	0.00
39	300488	恒峰工具	6,734	135,420.74	0.00
40	300489	中飞股份	7,319	128,521.64	0.00
41	002771	真视通	6,251	126,520.24	0.00
42	603085	天成自控	11,690	122,394.30	0.00
43	300480	光力科技	7,263	52,874.64	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	601318	中国平安	55,806,243.79	23.73
2	601985	中国核电	32,649,100.17	13.89
3	300352	北信源	13,961,578.89	5.94
4	000422	湖北宜化	11,662,893.25	4.96
5	600999	招商证券	10,703,532.16	4.55
6	601818	光大银行	8,720,000.00	3.71
7	002448	中原内配	8,526,792.66	3.63
8	300349	金卡股份	8,178,617.70	3.48
9	300425	环能科技	8,079,050.07	3.44
10	601992	金隅股份	6,696,207.00	2.85
11	600141	兴发集团	6,582,745.00	2.80
12	300463	迈克生物	6,523,990.68	2.77
13	603729	龙韵股份	5,573,242.11	2.37
14	300440	运达科技	5,403,099.00	2.30
15	300198	纳川股份	5,243,697.00	2.23
16	000969	安泰科技	5,171,041.96	2.20
17	300284	苏交科	4,952,776.61	2.11
18	600491	龙元建设	4,834,853.00	2.06
19	603898	好莱客	4,058,379.35	1.73
20	002665	首航节能	4,015,013.00	1.71

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	601985	中国核电	121,135,301.40	51.52
2	601318	中国平安	43,043,141.81	18.31
3	600959	江苏有线	23,626,982.60	10.05
4	600577	精达股份	21,072,924.86	8.96
5	600837	海通证券	20,443,043.28	8.69
6	000712	锦龙股份	18,991,145.81	8.08
7	600570	恒生电子	18,387,709.50	7.82
8	600030	中信证券	16,376,528.76	6.96
9	600016	民生银行	14,834,548.17	6.31
10	601166	兴业银行	14,239,000.00	6.06
11	600036	招商银行	14,217,277.57	6.05
12	002657	中金金财	12,954,529.86	5.51
13	600999	招商证券	10,955,006.00	4.66
14	601998	中信银行	10,838,727.00	4.61
15	000422	湖北宜化	10,018,017.73	4.26
16	601555	东吴证券	9,539,008.41	4.06
17	601818	光大银行	8,130,000.00	3.46
18	002085	万丰奥威	8,039,836.00	3.42
19	002749	国光股份	7,334,358.50	3.12
20	603729	龙韵股份	6,365,812.13	2.71
21	300284	苏交科	6,320,386.60	2.69
22	300426	唐德影视	5,850,129.60	2.49
23	603567	珍宝岛	5,090,020.00	2.16
24	603969	银龙股份	5,036,445.63	2.14

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	266,448,454.07
卖出股票收入（成交）总额	526,916,162.93

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	452,414,000.00	4.46
	其中：政策性金融债	452,414,000.00	4.46
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	452,414,000.00	4.46

## 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	150202	15 国开 02	3,100,000	311,674,000.00	3.07
2	150301	15 进出 01	1,000,000	100,580,000.00	0.99
3	140223	14 国开 23	400,000	40,160,000.00	0.40

## 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

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持有股指期货。

## 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股指期货。

### 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投资股指期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资股指期货。

## 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。

## 7.13 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	272,827.10
2	应收证券清算款	33,225,387.29
3	应收股利	-
4	应收利息	10,623,887.24
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,122,101.63

### 7.13.1 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投资国债期货。

### 7.13.2 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

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	300463	迈克生物	20,477,304.08	0.20	新股锁定
2	300443	金雷风电	9,571,324.68	0.09	新股锁定
3	300436	广生堂	7,065,698.83	0.07	新股锁定

4	300349	金卡股份	6,739,500.00	0.07	重大事项
---	--------	------	--------------	------	------

## § 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

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
958	10,918,499.57	10,394,345,117.37	99.37%	65,577,474.53	0.63%

### 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	56,941.34	0.0005%

### 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

## § 9 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	235,493,342.00
本报告期基金总申购份额	10,558,961,573.02
减:本报告期基金总赎回份额	334,532,323.12
本报告期基金拆分变动份额 ( 份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	10,459,922,591.90

## § 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

#### 1、本基金管理人的重大变动

自 2015 年 3 月 28 日起，丁经纬先生不再担任本基金的基金经理，由余志勇先生继续担任本基金的基金经理。具体内容请参阅 2015 年 3 月 28 日在《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》上刊登的相关公告。

## 2、本报告期基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内基金托管人未发生重大的人事变动报告期内，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。

## 10.3 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。

## 10.4 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。

## 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有限公司，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。

## 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

本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 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	
安信证券	2	222,028,544.12	31.39%	201,237.67	31.49%	-
新时代证券	1	188,096,403.44	26.59%	171,240.25	26.79%	-
中信证券	1	102,340,363.33	14.47%	90,561.30	14.17%	-
恒泰证券	1	94,678,378.99	13.38%	86,195.03	13.49%	-
海通证券	1	38,807,232.89	5.49%	34,340.52	5.37%	-
申万宏源	1	24,532,020.68	3.47%	22,333.89	3.49%	-
中信建投	1	18,296,123.13	2.59%	16,656.32	2.61%	-
平安证券	2	12,286,014.40	1.74%	10,871.91	1.70%	-
华泰证券	1	3,725,030.00	0.53%	3,296.28	0.52%	-
渤海证券	1	2,621,317.50	0.37%	2,386.46	0.37%	-

长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	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

本基金本报告期内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

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	成交金额	占当期债	成交金额	占当期权证

		成交总额的比例		券回购成交总额的比例		成交总额的比例
安信证券	17,714,050.00	28.26%	300,000,000.00	0.33%	-	-
新时代证券	823,600.00	1.31%	37,600,000,000.00	41.80%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	400,000,000.00	0.44%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	33,210,480.00	52.98%	39,910,000,000.00	44.36%	-	-
中信建投	-	-	4,500,000,000.00	5.00%	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	10,942,140.30	17.45%	7,250,000,000.00	8.06%	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	披露方式	披露日期
1	融通通泽灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-1-26
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、管理人网站	2015-2-2
3	融通基金管理有限公司关于融通通泽灵活配置混合型证券投资基金暂停申购、转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-2-6
4	融通通泽灵活配置混合型证券投资基金恢复（大额）申购（转换转入）公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-3-5
5	融通基金管理有限公司关于融通通泽灵活配置混合型证券投资基金暂停申购、转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-3-7
6	融通通泽灵活配置混合基金基金经理离任公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-3-28



7	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、管理人网站	2015-3-31
8	融通通泽灵活配置混合型证券投资基金恢复申购、转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-4-7
9	融通通泽灵活配置混合型证券投资基金暂停申购、转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-4-14
10	融通通泽灵活配置混合型证券投资基金恢复申购、转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-4-27
11	融通通泽灵活配置混合型证券投资基金暂停申购、转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-5-5
12	关于融通旗下部分开放式基金新增渤海银行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、管理人网站	2015-5-11
13	融通通泽灵活配置混合型证券投资基金恢复申购、转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-5-22
14	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、管理人网站	2015-5-27
15	融通通泽灵活配置混合型证券投资基金暂停申购、转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-5-28
16	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、管理人网站	2015-6-15
17	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、管理人网站	2015-6-26

## § 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。

具体内容请参阅 2015 年 3 月 28 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旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告》。

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

### 12.1 备查文件目录

- (一) 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决议生效的公告
- (二) 《融通通泽式灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通通泽灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通通泽灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- (五) 融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- (六) 基金托管人中国工商银行业务资格批件和营业执照
- (七) 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

### 12.2 存放地点

基金管理、基金托管人处。

### 12.3 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。