

融通领先成长混合型证券投资基金 (LOF) 2015 年年度报告摘要
(原融通领先成长股票型证券投资基金 (LOF))

2015 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 30 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。

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，“融通领先成长股票型证券投资基金 (LOF)” 更名为“融通领先成长混合型证券投资基金 (LOF)”，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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据融通领先成长混合型证券投资基金 (LOF)（以下简称“本基金”）基金合同规定，于 2016 年 3 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中的财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2015 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	融通领先成长混合 (LOF)
场内简称	融通领先
基金主代码	161610
前端交易代码	161610
后端交易代码	161660
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2007 年 4 月 30 日
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	6,129,152,901.41 份

基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2007 年 7 月 18 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于业绩能持续高速增长的上市公司, 通过积极主动的分散化投资策略, 在严格控制风险的前提下实现基金资产的持续增长, 为基金持有人获取长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金认为股价上升的主要推动力来自于企业盈利的不断增长。在中国经济长期高速增长的大背景下, 许多企业在一定时期表现出较高的成长性, 但只有符合产业结构发展趋势, 同时在技术创新、经营模式、品牌、渠道、成本等方面具有领先优势的企业, 才能保持业绩持续高速增长, 而这些企业正是本基金重点投资的目标和获得长期超额回报的基础。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中债综合全价(总值)指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金是较高预期收益较高预期风险的产品, 其预期收益与风险高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

注: 本基金 2015 年 10 月 1 日起启用新基准“沪深 300 指数收益率×80%+中债综合全价(总值)指数收益率×20%”。详见本基金管理人于 2015 年 11 月 11 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变更业绩比较基准及修改相关基金合同的公告》。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	涂卫东	田青
	联系电话	(0755) 26948666	(010) 67595096
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-883-8088、(0755) 26948088	(010) 67595096
传真		(0755) 26935005	(010) 66275853

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	基金管理人处、基金托管人处、深圳证券交易所

§ 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	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	-1,097,047,815.88	290,790,784.13	83,235,580.16
本期利润	-577,466,794.46	-4,514,570.13	159,172,841.00

加权平均基金份额本期利润	-0.1084	-0.0016	0.0481
本期基金份额净值增长率	71.02%	-0.55%	6.09%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0951	-0.0147	-0.1211
期末基金资产净值	7,630,978,496.35	1,770,155,582.15	2,270,104,444.78
期末基金份额净值	1.245	0.728	0.732

注：(1) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

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

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

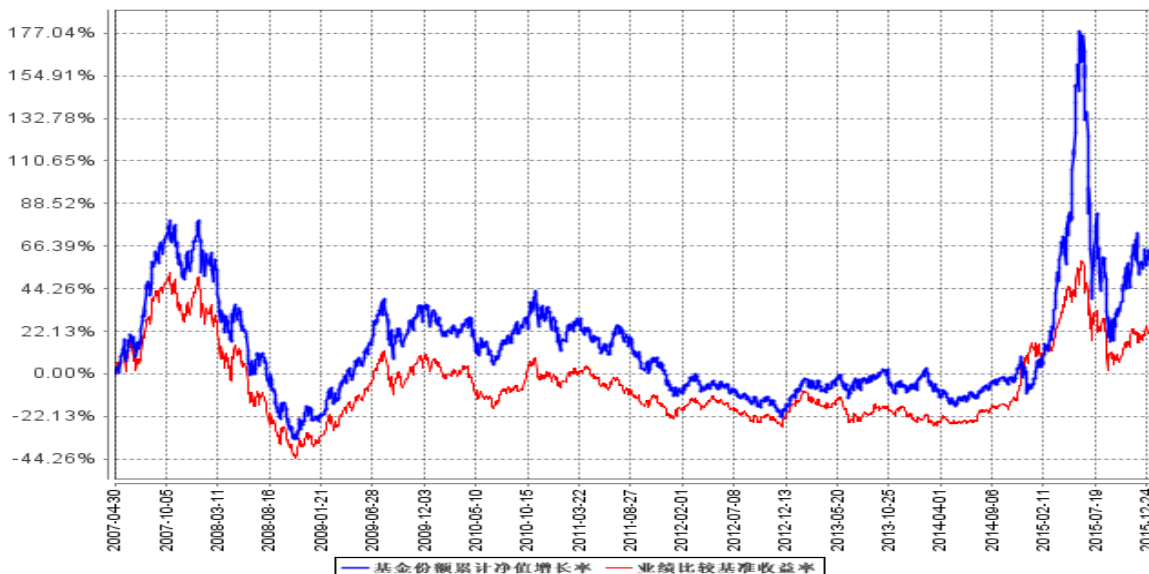
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	20.87%	2.68%	13.55%	1.34%	7.32%	1.34%
过去六个月	-18.79%	3.39%	-12.24%	2.14%	-6.55%	1.25%
过去一年	71.02%	3.19%	6.86%	1.99%	64.16%	1.20%
过去三年	80.43%	2.12%	43.87%	1.44%	36.56%	0.68%
过去五年	24.91%	1.80%	23.80%	1.29%	1.11%	0.51%
自基金合同生效起至今	61.66%	1.86%	21.01%	1.55%	40.65%	0.31%

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

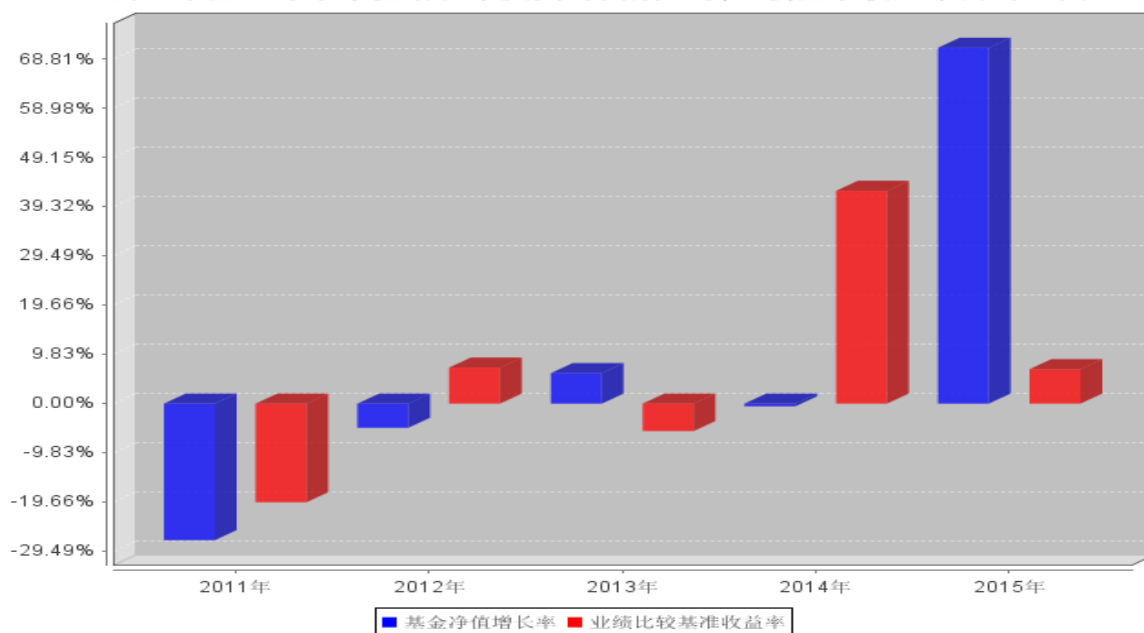


注：(1) 本基金由原通宝证券投资基金转型而来，转型日期为 2007 年 4 月 30 日。

(2) 本基金业绩基准项目分段计算，其中 2015 年 9 月 30 日之前（含此日）采用“沪深 300 指数收益率×80%+中信标普全债指数收益率×20%。”，2015 年 10 月 1 日起使用新基准即“沪深 300 指数收益率×80%+中债综合全价（总值）指数收益率×20%”。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

年度	每10份基金份额	现金形式发放	再投资形式发放	年度利润	备

	分红数	总额	总额	分配合计	注
2015	-	-	-	-	-
2014	-	-	-	-	-
2013	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

融通基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证监会证监基字[2001]8号文批准，于2001年5月22日成立，公司注册资本12500万元人民币。本公司的股东及其出资比例为：新时代证券股份有限公司60%、日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co., Ltd.）40%。

截至2015年12月31日，公司管理的基金共有三十七只：一只封闭式基金，即融通通乾封闭基金；三十六只开放式基金，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、融通月月添利基金、融通健康产业混合基金、融通转型三动力混合基金、融通互联网传媒混合基金、融通新区域新经济混合基金、融通通鑫混合基金、融通新能源混合基金、融通军工分级指数基金、融通证券分级指数基金、融通农业分级指数基金、融通跨界成长混合基金、融通新机遇混合基金和融通成长30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		
刘格菘	本基金、融通新能源灵活配置混合、融通新区域新经济灵活配置混合、融通互联网传媒灵活配置混合、融	2014年12月24日	-	6	经济学博士，毕业于中国人民银行研究生部，具有基金从业资格。曾任职于中国人民银行营业管理部，历

	通成长 30 灵活配置混合的基金经理				任中邮创业基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、中邮核心成长股票型证券投资基金基金经理。2014 年 9 月加入融通基金管理有限公司。
伍文友	本基金的基金经理、融通互联网传媒灵活配置混合	2015 年 8 月 29 日	-	5	毕业于中国人民银行研究部，获金融学硕士。5 年证券从业经验，具有基金从业资格。历任中国人寿资产管理有限公司助理研究员、建信基金管理有限公司研究员。2015 年 5 月加入融通基金管理有限公司。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

2015 年，我国宏观经济依然没有摆脱通货紧缩的阴影，PPI 连续负增长，GDP 增速继续探底。在全球需求低迷以及主要产油国不限产的影响下，以石油价格为代表的大宗商品价格 2015 年出现了大幅下跌，年末纽约原油期货价格比 2015 年年初累计下跌了 37%，并在 2016 年初跌破了 30 美元。从世界主要经济体的经济复苏情况看，美国的复苏基础比欧洲、日本以及新兴经济体坚实，因此美联储在 12 月的加息，也开启了大宗商品以及欧洲、新兴国家资本市场的大幅波动。2015 年，中国资本市场由于年初的融资资金、配资资金快速入市，以及年中政策主导下的去杠杆，导致 A 股市场大幅波动。

本基金的主要投资策略是围绕宏观经济转型的大背景，寻找中长期成长趋势确定性较强的行业，自下而上精选个股，按照企业家战略、管理层执行力、所在行业细分市场空间、企业竞争力几个角度，挖掘成长空间巨大的公司，伴随公司成长并获得长期投资回报。尽管 2015 年资本市场大幅波动，但从中长期角度看，宏观经济从投资主导向消费主导转型的趋势不会改变。在这一过程中，经济增长方式必然由原来的粗放式向更有质量的方式转变，民营经济占比进一步提升，新经济占宏观经济的比例逐步提升。在这一过程中，一些优秀的企业家会抓住新的产业趋势以及政策趋势，利用资本市场的融资优势，在经济转型过程中不断将自身的企业做大做强。我们的投资思路，就是在这一个确定性的中长期趋势中，寻找能够在未来成为中国经济新的支柱性行业内的优秀企业，并提前布局，分享企业成长红利，为投资人带来回报。

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 71.02%，同期业绩比较基准收益率 6.86%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为，2016年的宏观经济走势很难发生趋势性的变化，全年GDP增速在6.5%-7%之间的概率较大。从中长期看，我们认为在新的国家领导层供给侧改革等措施推动下，国有企业的效率提升的趋势较为确定，这会推动A股市场企业盈利预期的提升，我们认为这是A股市场中长期增长的基础。2016年A股市场不确定性因素来自于风险偏好的变化。我们认为，投资者风险偏好的高低取决于国内投资者对于中国经济未来改革转型成功的预期以及全球风险偏好的变化。因此，2016年我们将会重点关注改革措施的落地节奏以及效果、美联储政策的变化。

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

本基金本报告期内未进行利润分配，符合法律法规和基金合同的规定。

§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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

本基金2015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(2016)第21165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：融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产：		
银行存款	687,611,878.08	35,486,111.60
结算备付金	33,802,394.22	12,346,637.59
存出保证金	6,403,564.06	659,007.76
交易性金融资产	6,868,286,258.37	1,730,418,659.45
其中：股票投资	6,868,286,258.37	1,630,260,659.45
基金投资	-	-
债券投资	-	100,158,000.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	15,000,142.50	5,700,128.55
应收证券清算款	261,350,688.78	16,268,902.93

应收利息	172,289.90	3,526,593.01
应收股利	-	-
应收申购款	6,751,643.59	107,033.56
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	7,879,378,859.50	1,804,513,074.45
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2015年12月31日	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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	18,429,976.21
应付赎回款	220,644,334.71	6,698,760.19
应付管理人报酬	9,994,654.37	2,463,156.99
应付托管费	1,665,775.72	410,526.18
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	14,600,137.37	5,686,856.98
应交税费	65,649.13	65,649.13
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,429,811.85	602,566.62
负债合计	248,400,363.15	34,357,492.30
所有者权益:		
实收基金	2,380,480,439.05	944,821,872.49
未分配利润	5,250,498,057.30	825,333,709.66
所有者权益合计	7,630,978,496.35	1,770,155,582.15
负债和所有者权益总计	7,879,378,859.50	1,804,513,074.45

注:报告截止日 2015 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.245 元,基金份额总额 6,129,152,901.41 份。

7.2 利润表

会计主体: 融通领先成长混合型证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015 年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014 年12月31日
一、收入	-387,101,575.86	51,379,385.18

1. 利息收入	9,762,096.19	6,608,325.85
其中：存款利息收入	8,405,105.28	1,374,218.90
债券利息收入	1,282,035.62	3,725,900.60
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	74,955.29	1,508,206.35
其他利息收入	-	-
2. 投资收益	-931,878,683.17	340,011,758.25
其中：股票投资收益	-950,299,912.70	319,914,105.83
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-93,793.42	262,384.47
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	18,515,022.95	19,835,267.95
3. 公允价值变动收益	519,581,021.42	-295,305,354.26
4. 汇兑收益	-	-
5. 其他收入	15,433,989.70	64,655.34
减：二、费用	190,365,218.60	55,893,955.31
1. 管理人报酬	101,378,780.88	31,049,861.34
2. 托管费	16,896,463.41	5,174,976.83
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	71,546,078.79	19,159,832.28
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	543,895.52	509,284.86
三、利润总额	-577,466,794.46	-4,514,570.13
减：所得税费用	-	-
四、净利润	-577,466,794.46	-4,514,570.13

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通领先成长混合型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	944,821,872.49	825,333,709.66	1,770,155,582.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	-577,466,794.46	-577,466,794.46

7.4.1.2 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。

7.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.3 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、基金销售机构
中国建设银行	基金托管人、基金代销机构
新时代证券股份有限公司(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

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	205,505,497.16	0.42%	-	-

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 2015年1月1日至2015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	187,093.48	0.42%	-	-

关联方名称	上年度可比期间 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	-	-	-	-

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 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	101,378,780.88	31,049,861.34
其中：支付销售机构的客户维护费	23,485,461.56	6,142,726.17

注：1、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 1.5% 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。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	16,896,463.41	5,174,976.83

注：支付基金托管人中国建设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 × 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

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

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年12月31日
基金合同生效日（2007年4月30日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	44,418,366.00	44,418,366.00
期间申购/买入总份额	4,009,386.07	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	36,174,244.00	-
期末持有的基金份额	12,253,508.07	44,418,366.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.20%	1.83%

注：本基金管理人融通基金管理有限公司在本年度申购本基金的交易通过融通基金管理有限公司网上直销汇款交易方式办理，适用费率为零；赎回本基金的交易通过国泰君安证券股份有限公司办理，按交易所公布的基金交易费率计算并支付。

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

份额单位：人民币元

关联方名称	本期末 2015年12月31日		上年度末 2014年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
新时代证券	1,567,398.12	0.03%	-	-

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 2015年1月1日至 2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至 2014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
中国建设银行	687,611,878.08	7,658,360.70	35,486,111.60	1,270,186.86

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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（2015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

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
002174	游族网络	2015/7/23	重大资产重组	93.22	2016/2/15	80.58	7,187,919	718,823,133.84	670,057,809.18	-

注：本基金截至2015年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因从事银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因从事交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

§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	6,868,286,258.37	87.17
	其中：股票	6,868,286,258.37	87.17
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	15,000,142.50	0.19
	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	721,414,272.30	9.16
7	其他各项资产	274,678,186.33	3.49
8	合计	7,879,378,859.50	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	2,927,379,822.33	38.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	439,200,292.80	5.76
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	27,190,000.00	0.36
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	2,546,005,956.27	33.36
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,311.36	0.00
L	租赁和商务服务业	687,762,162.50	9.01
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	72,426,754.40	0.95
S	综合	168,319,958.71	2.21
	合计	6,868,286,258.37	90.01

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	002153	石基信息	4,805,009	725,556,359.00	9.51
2	002488	金固股份	24,909,545	722,376,805.00	9.47
3	002055	得润电子	18,003,338	696,009,047.08	9.12
4	002183	怡亚通	14,931,875	687,762,162.50	9.01

5	002174	游族网络	7,187,919	670,057,809.18	8.78
6	300367	东方网力	7,296,735	508,582,429.50	6.66
7	300332	天壕环境	18,000,012	439,200,292.80	5.76
8	002217	合力泰	20,006,198	339,105,056.10	4.44
9	300378	鼎捷软件	5,106,149	297,279,994.78	3.90
10	600718	东软集团	7,999,921	248,397,547.05	3.26

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	002055	得润电子	1,048,398,821.13	59.23
2	300104	乐视网	1,029,408,743.10	58.15
3	300367	东方网力	890,244,233.83	50.29
4	002373	千方科技	632,790,243.28	35.75
5	002174	游族网络	622,302,636.02	35.16
6	002153	石基信息	619,323,139.08	34.99
7	002383	合众思壮	614,751,797.02	34.73
8	000768	中航飞机	611,212,400.35	34.53
9	601328	交通银行	599,532,351.58	33.87
10	601989	中国重工	573,170,537.54	32.38
11	002183	怡亚通	569,472,830.08	32.17
12	002331	皖通科技	532,418,238.59	30.08
13	600030	中信证券	514,827,401.13	29.08
14	002217	合力泰	508,989,020.94	28.75
15	600804	鹏博士	489,793,775.97	27.67
16	002690	美亚光电	475,992,240.76	26.89
17	600038	中直股份	430,522,432.10	24.32
18	002488	金固股份	423,734,541.68	23.94
19	300379	东方通	416,176,774.68	23.51
20	300332	天壕环境	389,855,079.63	22.02
21	300137	先河环保	383,394,881.49	21.66
22	600701	工大高新	351,697,984.85	19.87
23	600485	信威集团	335,471,331.74	18.95

24	300337	银邦股份	318,247,492.62	17.98
25	600893	中航动力	316,025,357.54	17.85
26	300299	富春通信	313,903,100.64	17.73
27	002594	比亚迪	308,777,647.67	17.44
28	601628	中国人寿	308,396,541.11	17.42
29	600074	保千里	273,486,191.46	15.45
30	002325	洪涛股份	268,595,787.93	15.17
31	002312	三泰控股	259,307,523.24	14.65
32	300059	东方财富	254,677,172.73	14.39
33	600718	东软集团	253,983,756.93	14.35
34	600050	中国联通	251,765,165.92	14.22
35	300011	鼎汉技术	243,898,029.91	13.78
36	002127	新民科技	242,600,152.38	13.71
37	002407	多氟多	242,552,934.63	13.70
38	002625	龙生股份	235,090,595.98	13.28
39	601398	工商银行	233,938,164.17	13.22
40	600016	民生银行	216,210,618.84	12.21
41	000821	京山轻机	215,661,362.83	12.18
42	600536	中国软件	212,413,475.08	12.00
43	300174	元力股份	210,595,482.99	11.90
44	300378	鼎捷软件	210,444,213.75	11.89
45	000559	万向钱潮	209,695,650.67	11.85
46	000938	紫光股份	207,637,979.54	11.73
47	600703	三安光电	206,670,840.80	11.68
48	600745	中茵股份	205,235,439.58	11.59
49	000062	深圳华强	204,493,226.00	11.55
50	600585	海螺水泥	204,315,004.55	11.54
51	300017	网宿科技	203,596,357.57	11.50
52	600730	中国高科	196,567,371.46	11.10
53	002657	中科金财	193,667,480.70	10.94
54	002659	中泰桥梁	185,583,111.68	10.48
55	002394	联发股份	184,610,103.64	10.43
56	300166	东方国信	182,012,341.78	10.28
57	002739	万达院线	175,486,560.85	9.91
58	600756	浪潮软件	173,741,283.94	9.82
59	002389	南洋科技	170,344,702.27	9.62

60	300263	隆华节能	168,477,003.44	9.52
61	601857	中国石油	167,630,698.26	9.47
62	002281	光迅科技	167,392,889.37	9.46
63	601607	上海医药	161,431,221.37	9.12
64	600118	中国卫星	152,908,491.36	8.64
65	300245	天玑科技	150,712,261.61	8.51
66	002318	久立特材	148,654,044.64	8.40
67	000060	中金岭南	146,884,700.94	8.30
68	600869	智慧能源	141,157,446.33	7.97
69	000555	神州信息	135,094,108.46	7.63
70	600109	国金证券	134,807,872.14	7.62
71	300358	楚天科技	129,697,066.35	7.33
72	002280	联络互动	128,665,751.57	7.27
73	002298	中电鑫龙	126,782,507.77	7.16
74	300275	梅安森	125,427,365.56	7.09
75	600048	保利地产	124,659,809.09	7.04
76	603899	晨光文具	123,938,050.43	7.00
77	300284	苏文科	116,799,093.37	6.60
78	002429	兆驰股份	116,122,093.24	6.56
79	002589	瑞康医药	114,380,186.39	6.46
80	600617	国新能源	106,235,918.53	6.00
81	002124	天邦股份	105,164,393.93	5.94
82	601166	兴业银行	100,823,469.18	5.70
83	300209	天泽信息	100,816,652.33	5.70
84	600362	江西铜业	100,302,658.11	5.67
85	600000	浦发银行	98,737,938.30	5.58
86	000758	中色股份	96,654,911.45	5.46
87	000807	云铝股份	94,283,567.65	5.33
88	002387	黑牛食品	93,117,706.72	5.26
89	601988	中国银行	87,618,602.36	4.95
90	000069	华侨城 A	87,068,004.22	4.92
91	002540	亚太科技	86,134,999.87	4.87
92	600705	中航资本	85,434,478.02	4.83
93	002065	东华软件	80,572,110.02	4.55
94	600466	蓝光发展	80,203,488.69	4.53
95	002343	禾欣股份	79,498,373.07	4.49

96	300007	汉威电子	78,324,746.66	4.42
97	002701	奥瑞金	74,849,893.43	4.23
98	002385	大北农	74,156,484.59	4.19
99	600588	用友网络	71,604,750.92	4.05
100	300198	纳川股份	71,584,805.21	4.04
101	300058	蓝色光标	70,088,091.28	3.96
102	300203	聚光科技	68,536,194.98	3.87
103	300370	安控科技	66,181,603.30	3.74
104	002375	亚厦股份	65,460,985.65	3.70
105	600683	京投银泰	61,949,093.44	3.50
106	000793	华闻传媒	60,173,530.53	3.40
107	002284	亚太股份	59,846,250.30	3.38
108	002081	金螳螂	58,321,835.62	3.29
109	300403	地尔汉宇	57,235,340.88	3.23
110	600217	*ST 秦岭	53,019,356.49	3.00
111	600856	中天能源	51,696,239.74	2.92
112	601992	金隅股份	51,285,653.25	2.90
113	600153	建发股份	50,798,672.17	2.87
114	300162	雷曼股份	48,555,683.78	2.74
115	300416	苏试试验	47,196,000.00	2.67
116	600970	中材国际	46,901,067.60	2.65
117	002527	新时达	45,455,112.41	2.57
118	601688	华泰证券	45,376,324.84	2.56
119	600837	海通证券	44,131,999.10	2.49
120	300248	新开普	43,494,183.39	2.46
121	601390	中国中铁	43,438,765.31	2.45
122	002514	宝馨科技	43,196,914.39	2.44
123	300015	爱尔眼科	42,930,531.09	2.43
124	601669	中国电建	37,483,600.80	2.12

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	300104	乐视网	1,070,158,353.71	60.46
2	601328	交通银行	600,052,637.56	33.90

3	000768	中航飞机	579,016,587.95	32.71
4	002690	美亚光电	531,532,806.22	30.03
5	601989	中国重工	516,239,394.76	29.16
6	600030	中信证券	454,387,605.93	25.67
7	300137	先河环保	442,520,047.03	25.00
8	300367	东方网力	427,125,706.29	24.13
9	000821	京山轻机	415,013,096.33	23.45
10	002540	亚太科技	413,806,677.00	23.38
11	601628	中国人寿	383,323,466.69	21.65
12	002373	千方科技	381,448,283.16	21.55
13	002383	合众思壮	379,260,496.05	21.43
14	300337	银邦股份	337,318,333.27	19.06
15	600038	中直股份	331,356,978.00	18.72
16	002594	比亚迪	324,427,775.50	18.33
17	002312	三泰控股	311,236,698.43	17.58
18	002055	得润电子	277,644,724.76	15.68
19	002625	龙生股份	269,723,773.52	15.24
20	600074	保千里	264,097,082.67	14.92
21	300059	东方财富	258,654,167.63	14.61
22	300017	网宿科技	250,391,657.73	14.15
23	002331	皖通科技	250,083,738.83	14.13
24	002739	万达院线	247,997,190.65	14.01
25	600893	中航动力	242,480,934.25	13.70
26	600730	中国高科	241,839,528.69	13.66
27	002325	洪涛股份	229,933,130.00	12.99
28	600804	鹏博士	228,476,834.71	12.91
29	000062	深圳华强	226,773,297.51	12.81
30	600536	中国软件	224,738,548.21	12.70
31	601398	工商银行	220,785,374.76	12.47
32	300379	东方通	219,253,258.82	12.39
33	600050	中国联通	216,704,524.85	12.24
34	002657	中科金财	216,156,278.48	12.21
35	300011	鼎汉技术	215,988,452.43	12.20
36	000559	万向钱潮	212,905,935.44	12.03
37	600016	民生银行	210,295,437.83	11.88
38	002659	中泰桥梁	205,975,966.73	11.64
39	600485	信威集团	199,744,627.03	11.28
40	002281	光迅科技	199,665,815.80	11.28

41	600703	三安光电	198,771,671.12	11.23
42	002407	多氟多	196,971,062.68	11.13
43	300209	天泽信息	186,001,556.18	10.51
44	601607	上海医药	184,133,964.27	10.40
45	002394	联发股份	183,513,242.22	10.37
46	000555	神州信息	183,151,747.75	10.35
47	600745	中茵股份	182,370,333.46	10.30
48	002389	南洋科技	180,900,140.54	10.22
49	601988	中国银行	176,910,803.00	9.99
50	600869	智慧能源	176,785,317.75	9.99
51	600585	海螺水泥	173,226,436.80	9.79
52	601166	兴业银行	172,943,014.54	9.77
53	600701	工大高新	172,742,580.09	9.76
54	300358	楚天科技	161,328,309.57	9.11
55	002217	合力泰	156,182,209.23	8.82
56	600118	中国卫星	152,603,894.15	8.62
57	000060	中金岭南	148,834,924.36	8.41
58	002429	兆驰股份	140,565,453.79	7.94
59	300263	隆华节能	138,855,413.20	7.84
60	300299	富春通信	137,699,733.43	7.78
61	600109	国金证券	137,145,517.22	7.75
62	002124	天邦股份	133,334,209.79	7.53
63	300284	苏交科	130,754,155.97	7.39
64	300166	东方国信	129,369,611.41	7.31
65	601857	中国石油	126,767,463.60	7.16
66	300370	安控科技	121,658,500.42	6.87
67	600048	保利地产	121,121,942.12	6.84
68	002488	金固股份	115,080,582.29	6.50
69	002127	新民科技	114,869,660.21	6.49
70	600000	浦发银行	112,876,793.42	6.38
71	603899	晨光文具	109,917,518.18	6.21
72	002589	瑞康医药	108,311,175.43	6.12
73	002065	东华软件	107,595,915.09	6.08
74	600466	蓝光发展	103,188,382.73	5.83
75	002385	大北农	102,444,086.98	5.79
76	002387	黑牛食品	101,660,604.88	5.74
77	000758	中色股份	101,214,867.62	5.72
78	600362	江西铜业	100,786,520.46	5.69

79	000807	云铝股份	98,380,758.56	5.56
80	002318	久立特材	96,825,247.25	5.47
81	002701	奥瑞金	95,092,199.41	5.37
82	002298	中电鑫龙	94,982,510.45	5.37
83	600588	用友网络	94,884,752.14	5.36
84	300007	汉威电子	91,191,986.68	5.15
85	300248	新开普	90,252,783.88	5.10
86	600617	国新能源	89,458,721.88	5.05
87	300006	莱美药业	88,037,534.47	4.97
88	600705	中航资本	81,992,228.16	4.63
89	600036	招商银行	81,644,050.21	4.61
90	000002	万科A	80,186,881.36	4.53
91	000069	华侨城A	76,780,034.84	4.34
92	002514	宝馨科技	75,189,593.02	4.25
93	002284	亚太股份	71,744,925.61	4.05
94	300198	纳川股份	71,374,152.08	4.03
95	000793	华闻传媒	70,445,550.76	3.98
96	002375	亚厦股份	69,766,491.27	3.94
97	300058	蓝色光标	67,601,951.74	3.82
98	002280	联络互动	66,217,011.79	3.74
99	600584	长电科技	63,571,899.69	3.59
100	002363	隆基机械	62,432,478.15	3.53
101	300203	聚光科技	59,287,902.26	3.35
102	300403	地尔汉宇	57,475,675.73	3.25
103	600683	京投银泰	56,577,427.38	3.20
104	000402	金融街	55,829,507.67	3.15
105	002081	金螳螂	53,367,881.38	3.01
106	000718	苏宁环球	52,293,165.99	2.95
107	600270	外运发展	51,996,506.01	2.94
108	300015	爱尔眼科	51,379,573.53	2.90
109	000938	紫光股份	51,090,398.28	2.89
110	600970	中材国际	48,833,711.41	2.76
111	600153	建发股份	48,668,752.29	2.75
112	601992	金隅股份	46,992,862.78	2.65
113	002527	新时达	46,609,661.34	2.63
114	600856	中天能源	46,089,620.59	2.60
115	601688	华泰证券	44,961,769.69	2.54
116	600837	海通证券	42,442,365.99	2.40

117	601390	中国中铁	42,364,977.02	2.39
118	300162	雷曼股份	41,872,218.46	2.37
119	300430	诚益通	41,466,749.50	2.34
120	300389	艾比森	40,109,856.34	2.27
121	002665	首航节能	37,747,827.89	2.13
122	300416	苏试试验	36,216,000.00	2.05
123	601669	中国电建	35,997,718.48	2.03
124	300369	绿盟科技	35,458,032.11	2.00

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	27,524,928,540.42
卖出股票收入（成交）总额	21,856,248,256.80

注：表中“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均指成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	6,403,564.06
2	应收证券清算款	261,350,688.78
3	应收股利	-
4	应收利息	172,289.90
5	应收申购款	6,751,643.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	274,678,186.33

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

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	002174	游族网络	670,057,809.18	8.78	重大事项停牌

§ 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
230,741	26,562.91	1,957,830,682.19	31.94%	4,171,322,219.22	68.06%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	融通基金管理有限公司	8,244,122.00	4.18%
2	天津证券登记公司	5,389,424.00	2.73%
3	叶风	1,907,667.00	0.97%
4	王金明	1,673,100.00	0.85%
5	吴颂今	1,228,070.00	0.62%
6	卢砺锋	1,178,034.00	0.60%
7	许玉明	1,068,572.00	0.54%
8	江晓文	942,972.00	0.48%
9	李玲	901,946.00	0.46%
10	史琼媛	887,000.00	0.45%

注：持有人为场内持有人。

9.3 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	1,150,273.94	0.0188%

9.4 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	50-100
本基金基金经理持有本开放式基金	50-100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2007年4月30日)基金份额总额	500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	2,432,760,950.13
本报告期基金总申购份额	13,558,917,377.49
减:本报告期基金总赎回份额	9,862,525,426.21
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	6,129,152,901.41

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 基金管理人的重大变动

2015 年 1 月 30 日，2014 年年度股东会会议决议通过，聘任孟朝霞女士、黄庆华先生担任公司董事；奚星华先生、涂卫东先生不再担任公司董事。公司已于 2015 年 2 月 12 日向中国证券监督管理委员会备案，同时抄送中国证券监督管理委员会深圳监管局。

2015 年 4 月 20 日至 4 月 22 日，股东会 2015 年第二次临时会议决议通过，聘任颜锡廉先生、薛迈雅先生担任公司董事；Blair Pickerell（裴布雷）先生、Frederick Reidenbach（弗莱德）先生不再担任公司董事。公司已于 2015 年 6 月 12 日向中国证券监督管理委员会备案，同时抄送中国证券监督管理委员会深圳监管局；

2015 年 6 月 18 日至 6 月 23 日，股东会 2015 年第四次临时会议决议通过，田德军先生不再担任公司董事长及董事职务，聘任高峰先生担任公司第五届董事会董事及公司第五届董事会董事长；本期间公司已履行完成高峰先生任职流程的监管审批程序，并于 2015 年 8 月 12 日完成董事长工商变更备案程序；

2015 年 9 月 2 日，公司发布公告，聘任刘晓玲女士为公司副总经理。该变更事项，经融通基金管理有限公司第五届董事会第一次会议审议并通过，并按规定向中国证券投资基金业协会报备；

经融通基金管理有限公司股东会 2015 年第五次临时会议审议通过，聘任刘宇先生担任公司监事，已按规定完成监事工商变更备案程序。

11.2.2 基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本基金的基金托管人中国建设银行于 2015 年 1 月 4 日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。于 2015 年 9 月 18 日发布任免通知，解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙),该事务所自 2011 年 10 月 20 日以来为本基金提供审计服务至今。本基金本报告期本年度应支付的审计费用为人民币 100,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,本基金的基金管理人、托管人的托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券	1	11,369,073,280.53	23.02%	10,135,812.03	22.71%	-
中泰证券	1	10,510,325,544.79	21.28%	9,687,946.94	21.70%	-
国泰君安	1	10,293,775,208.76	20.85%	9,159,147.19	20.52%	-
国金证券	1	5,229,652,140.36	10.59%	4,716,841.92	10.57%	-
中银国际	1	3,289,030,348.19	6.66%	2,967,334.13	6.65%	-
申万宏源	2	2,653,662,846.03	5.37%	2,455,624.25	5.50%	-
西南证券	2	2,449,605,885.83	4.96%	2,232,313.79	5.00%	-
华泰证券	1	1,175,513,508.14	2.38%	1,070,182.03	2.40%	-
招商证券	1	1,137,619,228.80	2.30%	1,036,723.69	2.32%	-
中金公司	1	1,065,561,423.39	2.16%	984,089.86	2.20%	-
新时代证券	1	205,505,497.16	0.42%	187,093.48	0.42%	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	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
要, 并能为本基金提供全面的信息服务;

6) 研究实力较强, 有固定的研究机构和专门研究人员, 能及时为本基金提供高质量的咨询服
务, 包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告, 并能根据基
金投资的特定要求, 提供专门研究报告。

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

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

(3) 交易单元变更情况

本报告期内, 本基金新增西南证券交易单元 2 个、招商证券、信达证券交易单元各 1 个, 原齐
鲁证券更名为中泰证券, 原申银万国证券交易单元和宏源证券交易单元因两机构合并统一变更为
申万宏源证券交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

融通基金管理有限公司
二〇一六年三月三十日