

融通行业景气证券投资基金 2015 年年度报告摘要

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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据融通行业景气证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同规定，于 2016 年 3 月 23 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	融通行业景气混合
基金主代码	161606
前端交易代码	161606
后端交易代码	161656
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 4 月 29 日
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,273,330,954.80 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过把握行业发展趋势、行业景气程度以及市场运行趋势为持有人获取长期稳定的投资收益。
投资策略	在对市场趋势判断的前提下，重视仓位选择和行业配置，强调以行业为导向进行个股选择，投资于具有良好成长性的行业及其上市公司股票，把握由市场需求、技术进步、国家政策、行业整合等因素带来的行业性投资

	机会。公司基本面是行业投资价值的直接反映，将结合行业景气情况选择该行业内最具代表性的上市公司作为投资对象。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+中债综合全价（总值）指数收益率×30%
风险收益特征	在锁定可承受风险的基础上，追求较高收益。

注：本基金自 2015 年 10 月 1 日起启用新的业绩比较基准：“沪深 300 指数收益率×70%+中债综合全价（总值）指数收益率×30%”。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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	涂卫东	汤嵩彦
	联系电话	(0755) 26948666	95559
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		400-883-8088、(0755) 26948088	95559
传真		(0755) 26935005	(021) 62701216

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

§ 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	688,406,037.97	145,322,739.23	382,804,207.55
本期利润	745,279,629.44	59,393,315.84	379,504,451.38
加权平均基金份额本期利润	0.5099	0.0209	0.1099
本期基金份额净值增长率	46.86%	5.36%	14.74%
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	-0.1864	-0.6257	-0.6963
期末基金资产净值	1,580,357,692.88	1,879,659,150.52	2,407,955,700.73
期末基金份额净值	1.241	0.845	0.802

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)。

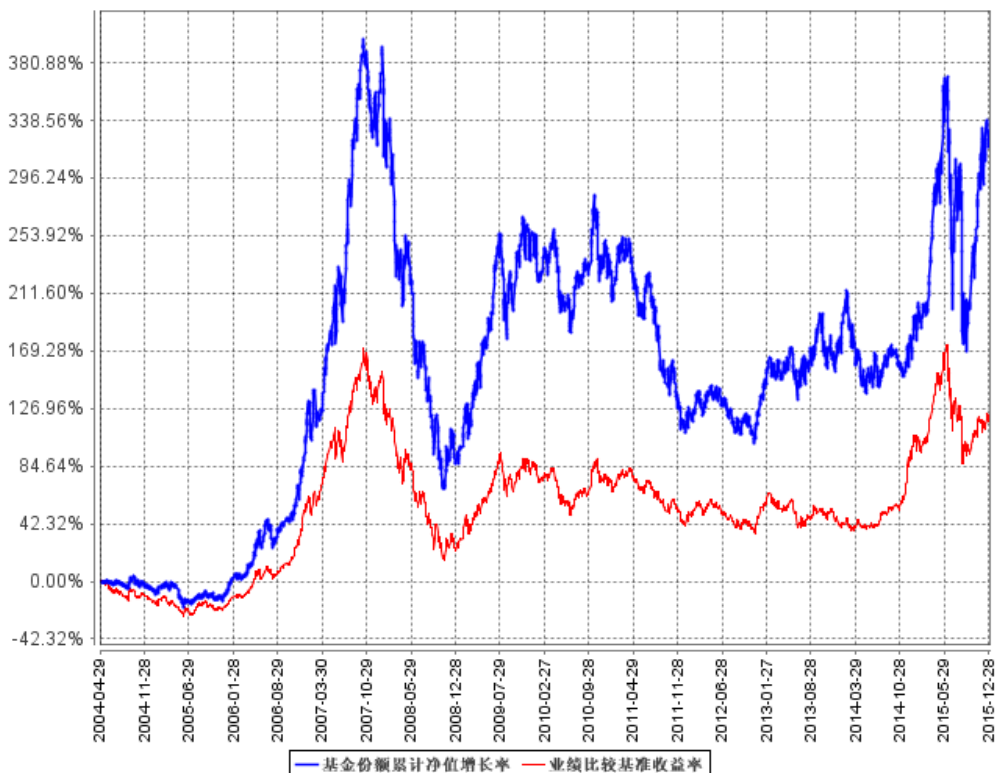
3.2 基金净值表现

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	38.66%	2.38%	12.08%	1.17%	26.58%	1.21%
过去六个月	5.08%	3.66%	-10.11%	1.87%	15.19%	1.79%
过去一年	46.86%	3.04%	7.26%	1.74%	39.60%	1.30%
过去三年	77.54%	2.16%	41.42%	1.26%	36.12%	0.90%
过去五年	24.60%	1.88%	25.54%	1.13%	-0.94%	0.75%
自基金合同生效起至今	319.23%	1.81%	117.66%	1.25%	201.57%	0.56%

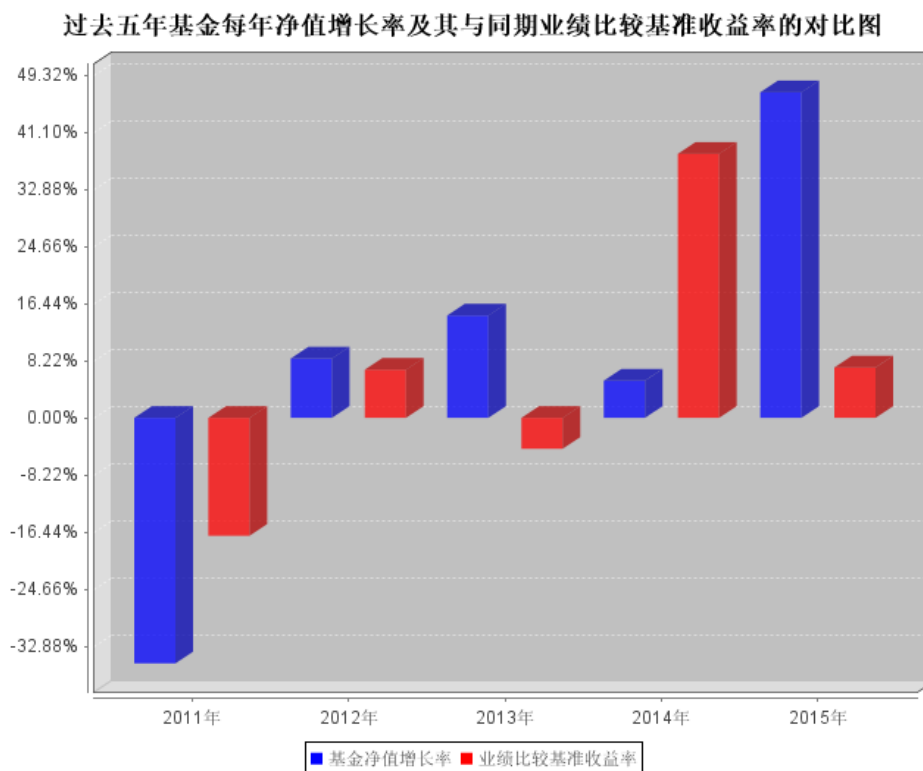
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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：本基金业绩基准项目分段计算，其中 2009 年 12 月 31 日之前（含此日）采用“70%×上证综合指数+30%×银行间债券综合指数”，2010 年 1 月 1 日至 2015 年 9 月 30 日采用“沪深 300 指数收益率×70%+中信标普全债指数收益率×30%”，2015 年 10 月 1 日起使用新基准即“沪深 300 指数收益率×70%+中债综合全价（总值）指数收益率×30%”。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
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		
邹曦	本基金的基金经理	2012 年 7 月 3 日	-	14	中国人民银行研究生部金融学硕士，具有基金从业资格。1996 年至 1998 年就职于中国航空技术进出口总公司福建分公司；2001 年至今就职于融通基金管理有限公司，历任市场拓展部总监助理、机构理财部总监助理、行业分析师、宏观策略分析师、基金管理部总监、研究策划部总监。
严菲	本基金的基金经理、融通蓝筹成长混合基金的基金经理	2012 年 1 月 12 日	2015 年 6 月 19 日	12	经济学硕士，具有证券从业资格。曾先后就职于日盛嘉富证券国际上海代表处、红塔证券从事证券研究工作。2006 年 7 月加入融通基金管理有限公司任行业研究员。

注：任职日期和离任日期指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

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 年沪深 300 指数上涨 5.6%，A 股市场出现大幅波动。上半年延续了 2014 年的牛市行情，对于改革和转型的憧憬，加上流动性的推动，导致市场大幅上涨；从 6 月份开始，对改革和转型过于乐观的预期得到修正，同时股市流动性逆转，市场出现连续两轮大幅下跌，一直延续到 2016 年初。

2015 年，融通行业景气基金净值上涨 46.9%，超越同期业绩比较基准，在同类基金中处于中

上水平。本基金在上半年主要配置旅游、互联网、房地产、化工、有色金属等板块，以及盈利驱动的白马成长股，虽然净值获得较大涨幅，但是落后市场同类基金。从 5-6 月份开始，考虑到明显泡沫化的市场风险，本基金主动降低了股票仓位，一定程度避开了 6-7 月份的第一轮市场大幅下跌。其后，本基金一直保持较高股票仓位，重点配置传媒、农业养殖、新能源汽车等板块，以及白马成长股，虽然没有避开 8 月份的市场第二轮下跌，但是下半年依然获得较好的收益。

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 46.86%，同期业绩比较基准收益率为 7.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，不宜过分悲观。我们正处在大变革的时代，纠结于宏观经济数据和经济景气状态意义不大，改革和转型的切实变化才能真正改变中国和 A 股市场的基本面，从而带来股票市场的变化。其实，中国经济的改革和转型一直都在稳步推进之中，过于乐观和过于悲观的预期都是短视的。

就改革而言，供给侧改革应该是今后两年的重点，其核心任务是“三去一降一补”。除了去产能去杠杆的减法项之外，我们更应当关注降成本和补短板的加法项，重点在于投融资体制改革。预计专项建设基金和 PPP 将成为新投融资体制的主要形式，其核心在于国家资本与民营资本的有效结合，具体表现为新兴产业的“国家 PE”与基础设施的“官督商办”，从而通过市场化机制提高投资效率。从投向来看，三个方向：能带来消费的投资、新兴产业的基础设施和民生补课的投资，将成为政府主导推动的主要基建投资方向。这样的投资既不会造成新的过剩产能，又能为转型提供有力的支持，其原则在于“逆经济周期短期不经济，顺产业周期长期经济”。投融资体制改革以及随之带来的较大规模基建投资，将为稳定经济增长提供有力的支持，兼顾了供给侧和需求侧，是本轮改革成功的必由路径。基于此的投资机会，可以称为“新基建”。

就转型而言，消费结构转变应该是重点。某种意义上而言，互联网+的发展的主要效果在于提升消费增长，改变消费形态。随着居民财富积累和分配结构的自然改进，影视传媒、旅游、电商等新型消费形态将获得快速发展，促进中国经济结构向消费转型。相关的板块会有较好的投资机会，可以称之为“新消费”。

我们认为，随着今年改革进程的实质性推进和新消费形态的快速增长，中国经济有望在 2-3 季度出现企稳迹象。这种稳增长实际上并不来自需求侧的经济政策，而是供给侧改革和经济结构自然转型的效果。由此，A 股市场将会重新燃起对改革和转型的期望，从而进入新的上升周期。就结构而言，我们看好新基建和新消费相关板块，以及农业养殖行业的投资机会。

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。

§ 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

2015 年度，基金托管人在融通行业景气证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2015 年度，融通基金管理有限公司在融通行业景气证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

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

2015 年度，由融通基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关融通行业景气证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 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 21161 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：融通行业景气证券投资基金

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	104,806,995.91	2,055,611.39
结算备付金	14,863,042.25	48,266,954.83
存出保证金	1,177,635.08	1,389,808.79
交易性金融资产	1,531,225,596.32	1,851,538,203.52
其中：股票投资	1,493,176,996.32	1,761,385,203.52
基金投资	-	-
债券投资	38,048,600.00	90,153,000.00
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	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	672,810.34	3,071,875.99
应收股利	-	-
应收申购款	12,666,157.96	393,781.32
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,665,412,237.86	1,906,716,235.84

负债和所有者权益	本期末 2015 年 12 月 31 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	40,691,162.95	8,932,105.71
应付赎回款	38,858,875.39	7,794,822.24
应付管理人报酬	1,815,930.04	2,350,723.00
应付托管费	302,655.02	391,787.18
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,023,556.52	6,304,793.21
应交税费	47,760.00	47,760.00
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,314,605.06	1,235,093.98
负债合计	85,054,544.98	27,057,085.32
所有者权益:		
实收基金	1,273,330,954.80	2,225,161,256.94
未分配利润	307,026,738.08	-345,502,106.42
所有者权益合计	1,580,357,692.88	1,879,659,150.52
负债和所有者权益总计	1,665,412,237.86	1,906,716,235.84

注:报告截止日 2015 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.241 元,基金份额总额 1,273,330,954.80 份。

7.2 利润表

会计主体: 融通行业景气证券投资基金

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	793,795,036.11	125,360,875.49
1. 利息收入	2,711,044.40	6,271,968.42
其中: 存款利息收入	1,153,724.62	2,131,794.62
债券利息收入	1,556,722.85	2,952,058.95
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	596.93	1,188,114.85
其他利息收入	-	-

2. 投资收益	733,972,976.60	204,839,414.86
其中：股票投资收益	726,517,091.52	191,479,987.57
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-212,100.00	584,589.36
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	7,667,985.08	12,774,837.93
3. 公允价值变动收益	56,873,591.47	-85,929,423.39
4. 汇兑收益	-	-
5. 其他收入	237,423.64	178,915.60
减：二、费用	48,515,406.67	65,967,559.65
1. 管理人报酬	23,044,453.11	33,479,087.14
2. 托管费	3,840,742.20	5,579,847.93
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	21,109,248.76	26,320,148.64
5. 利息支出	-	66,663.86
其中：卖出回购金融资产支出	-	66,663.86
6. 其他费用	520,962.60	521,812.08
三、利润总额	745,279,629.44	59,393,315.84
减：所得税费用	-	-
四、净利润	745,279,629.44	59,393,315.84

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通行业景气证券投资基金

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）	2,225,161,256.94	-345,502,106.42	1,879,659,150.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	745,279,629.44	745,279,629.44
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-951,830,302.14	-92,750,784.94	-1,044,581,087.08
其中：1. 基金申购款	496,540,181.21	93,936,862.08	590,477,043.29
2. 基金赎回款	-1,448,370,483.35	-186,687,647.02	-1,635,058,130.37
四、本期向基金份额持有	-	-	-

人分配利润产生的基金净值变动			
五、期末所有者权益（基金净值）	1,273,330,954.80	307,026,738.08	1,580,357,692.88
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,001,700,956.56	-593,745,255.83	2,407,955,700.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	59,393,315.84	59,393,315.84
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-776,539,699.62	188,849,833.57	-587,689,866.05
其中：1.基金申购款	276,845,464.21	-40,861,928.56	235,983,535.65
2.基金赎回款	-1,053,385,163.83	229,711,762.13	-823,673,401.70
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）	2,225,161,256.94	-345,502,106.42	1,879,659,150.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 孟朝霞 _____

基金管理人负责人

_____ 颜锡廉 _____

主管会计工作负责人

_____ 刘美丽 _____

会计机构负责人

7.4 报表附注

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

7.4.1.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

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、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	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

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		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	560,772,267.29	4.11%	459,684,511.82	2.67%

7.4.4.1.2 债券回购交易

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		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券 回购成交总额的比例
新时代证券	-	-	150,000,000.00	3.92%

7.4.4.1.3 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。

7.4.4.1.4 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	512,129.22	4.16%	23.52	0.00%

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	418,496.75	2.71%	210,109.70	3.33%

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	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	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	23,044,453.11	33,479,087.14
其中：支付销售机构的客户维护费	6,257,599.82	8,483,220.79

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 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

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

7.4.4.2.2 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 12 月 31 日	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	3,840,742.20	5,579,847.93

注：支付基金托管人交通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：

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

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

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。

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末,基金管理人的主要股东及其控制的机构均未持有本基金份额。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 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
交通银行	104,806,995.91	231,444.69	2,055,611.39	237,723.00

注:本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管,按银行同业利率计息。本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司,按银行同业利率计息。于2015年12月31日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示(2014年12月31日:同)。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

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

本基金本报告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
300351	永贵电器	2015-10-19	重大事项停牌	36.43	2016-2-18	29.80	1,113,947	33,009,302.92	40,581,089.21	-
002707	众信旅游	2015-11-16	重大事项停牌	52.62	2016-3-15	47.36	653,902	32,949,997.41	34,408,323.24	-
300011	鼎汉技术	2015-12-31	临时停牌	29.80	2016-1-22	26.82	263,697	8,497,882.00	7,858,170.60	-

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	1,493,176,996.32	89.66
	其中：股票	1,493,176,996.32	89.66
2	固定收益投资	38,048,600.00	2.28
	其中：债券	38,048,600.00	2.28
	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	119,670,038.16	7.19
7	其他各项资产	14,516,603.38	0.87
8	合计	1,665,412,237.86	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	285,512,321.89	18.07

B	采矿业	-	-
C	制造业	644,210,868.81	40.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	19,535,500.00	1.24
F	批发和零售业	18,742,112.45	1.19
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	51,242,773.70	3.24
J	金融业	-	-
K	房地产业	133,441,782.75	8.44
L	租赁和商务服务业	34,408,323.24	2.18
M	科学研究和技术服务业	11,215,562.64	0.71
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	281,514,810.84	17.81
S	综合	13,352,940.00	0.84
	合计	1,493,176,996.32	94.48

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	002292	奥飞动漫	2,826,874	146,177,654.54	9.25
2	002458	益生股份	3,493,187	132,042,468.60	8.36
3	300364	中文在线	717,862	127,779,436.00	8.09
4	600622	嘉宝集团	7,458,225	126,715,242.75	8.02
5	002343	禾欣股份	2,054,897	124,732,247.90	7.89
6	002475	立讯精密	3,725,057	119,015,571.15	7.53
7	002234	民和股份	5,796,730	104,225,205.40	6.60
8	002466	天齐锂业	704,824	99,203,978.00	6.28
9	002407	多氟多	710,409	54,175,790.34	3.43
10	002299	圣农发展	2,239,411	49,244,647.89	3.12

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	600376	首开股份	162,375,106.26	8.64
2	600048	保利地产	157,677,018.48	8.39
3	000060	中金岭南	157,615,927.74	8.39
4	601628	中国人寿	152,106,823.79	8.09
5	600201	生物股份	146,135,795.98	7.77
6	000006	深振业A	145,219,260.97	7.73
7	300284	苏交科	144,164,624.35	7.67
8	000069	华侨城A	143,871,731.47	7.65
9	600362	江西铜业	137,333,825.42	7.31
10	002343	禾欣股份	136,412,251.75	7.26
11	002475	立讯精密	134,404,817.09	7.15
12	600005	武钢股份	124,592,811.91	6.63
13	002299	圣农发展	119,274,345.67	6.35
14	300115	长盈精密	112,132,310.46	5.97
15	000732	泰禾集团	110,569,880.51	5.88
16	002234	民和股份	107,797,616.08	5.73
17	600325	华发股份	107,199,649.16	5.70
18	601318	中国平安	106,578,364.42	5.67
19	600622	嘉宝集团	105,544,909.80	5.62
20	002458	益生股份	105,292,735.68	5.60
21	002157	正邦科技	98,373,097.09	5.23
22	002292	奥飞动漫	98,324,296.11	5.23
23	002594	比亚迪	96,276,031.71	5.12
24	601601	中国太保	96,173,078.24	5.12
25	000703	恒逸石化	86,057,817.94	4.58
26	002465	海格通信	85,959,589.78	4.57
27	300364	中文在线	84,409,827.79	4.49
28	002466	天齐锂业	84,168,359.39	4.48
29	000651	格力电器	79,692,189.75	4.24
30	600999	招商证券	75,178,356.59	4.00
31	601633	长城汽车	75,116,416.52	4.00

32	000998	隆平高科	64,769,163.56	3.45
33	000712	锦龙股份	64,081,492.94	3.41
34	000002	万科A	63,609,977.57	3.38
35	601336	新华保险	63,133,191.78	3.36
36	000046	泛海控股	60,908,678.57	3.24
37	002546	新联电子	58,441,055.89	3.11
38	002407	多氟多	58,114,857.94	3.09
39	600958	东方证券	57,302,943.37	3.05
40	000807	云铝股份	56,271,376.34	2.99
41	601233	桐昆股份	55,555,123.95	2.96
42	600058	五矿发展	55,186,421.41	2.94
43	000090	天健集团	54,312,004.09	2.89
44	000718	苏宁环球	47,563,080.99	2.53
45	601800	中国交建	46,355,247.51	2.47
46	600409	三友化工	44,586,351.25	2.37
47	000821	京山轻机	43,201,160.53	2.30
48	002714	牧原股份	42,980,111.70	2.29
49	601788	光大证券	40,070,586.20	2.13
50	600801	华新水泥	39,446,885.17	2.10
51	000789	万年青	39,067,066.80	2.08
52	600006	东风汽车	38,605,070.80	2.05
53	603019	中科曙光	38,565,526.80	2.05
54	300032	金龙机电	38,437,435.48	2.04
55	002425	凯撒股份	38,064,282.66	2.03

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	600048	保利地产	280,169,332.20	14.91
2	600376	首开股份	247,679,899.14	13.18
3	000024	招商地产	229,340,455.35	12.20
4	601318	中国平安	212,630,871.27	11.31
5	000060	中金岭南	193,831,732.98	10.31
6	300144	宋城演艺	191,374,402.37	10.18
7	600201	生物股份	184,280,502.76	9.80

8	300145	南方泵业	183,876,658.93	9.78
9	601628	中国人寿	166,224,315.77	8.84
10	601633	长城汽车	163,635,169.24	8.71
11	601601	中国太保	159,319,423.30	8.48
12	601888	中国国旅	154,106,275.16	8.20
13	300284	苏交科	146,305,465.93	7.78
14	000069	华侨城 A	145,347,566.01	7.73
15	600999	招商证券	143,060,719.89	7.61
16	000006	深振业 A	141,779,025.06	7.54
17	002475	立讯精密	141,575,586.05	7.53
18	600362	江西铜业	138,334,572.66	7.36
19	002157	正邦科技	122,103,700.18	6.50
20	000732	泰禾集团	119,499,312.71	6.36
21	600005	武钢股份	116,395,765.62	6.19
22	000703	恒逸石化	115,151,002.44	6.13
23	300115	长盈精密	100,546,022.94	5.35
24	601233	桐昆股份	100,534,559.27	5.35
25	600325	华发股份	99,873,139.90	5.31
26	002470	金正大	94,020,772.54	5.00
27	002465	海格通信	88,434,257.10	4.70
28	601688	华泰证券	82,393,855.95	4.38
29	000001	平安银行	77,175,823.02	4.11
30	002410	广联达	76,240,321.50	4.06
31	002594	比亚迪	76,232,377.60	4.06
32	000651	格力电器	75,210,979.35	4.00
33	600030	中信证券	73,866,950.60	3.93
34	000046	泛海控股	71,718,815.61	3.82
35	002299	圣农发展	68,989,960.70	3.67
36	000998	隆平高科	68,814,298.86	3.66
37	000002	万科 A	68,161,865.02	3.63
38	000821	京山轻机	66,999,173.75	3.56
39	601336	新华保险	65,696,477.84	3.50
40	000712	锦龙股份	65,329,336.01	3.48
41	000807	云铝股份	61,518,590.30	3.27
42	600006	东风汽车	59,901,806.69	3.19
43	600958	东方证券	56,880,219.79	3.03
44	000685	中山公用	55,835,309.68	2.97
45	600168	武汉控股	53,970,500.72	2.87

46	600461	洪城水业	53,774,947.02	2.86
47	601788	光大证券	53,381,305.55	2.84
48	600008	首创股份	52,225,866.48	2.78
49	600058	五矿发展	49,525,241.54	2.63
50	000090	天健集团	49,135,562.90	2.61
51	002546	新联电子	47,509,267.48	2.53
52	600406	国电南瑞	43,789,593.30	2.33
53	601800	中国交建	43,482,675.08	2.31
54	300012	华测检测	39,842,783.95	2.12
55	600109	国金证券	39,534,643.05	2.10
56	300032	金龙机电	39,084,188.52	2.08
57	300017	网宿科技	38,229,427.78	2.03
58	002714	牧原股份	37,853,440.95	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。

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	6,303,241,820.68
卖出股票收入（成交）总额	7,354,753,248.87

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”均按成交单价乘以成交数量填列，相关交易费用不考虑。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	38,048,600.00	2.41
	其中：政策性金融债	38,048,600.00	2.41
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	38,048,600.00	2.41

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	150215	15 国开 15	300,000	30,039,000.00	1.90
2	150202	15 国开 02	80,000	8,009,600.00	0.51

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

本基金本报告期末持有国债期货。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

8.12.2 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,177,635.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	672,810.34
5	应收申购款	12,666,157.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,516,603.38

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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
68,279	18,648.94	174,412,513.49	13.70%	1,098,918,441.31	86.30%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	463,845.55	0.0364%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2004 年 4 月 29 日）基金份额总额	2,547,018,654.32
本报告期期初基金份额总额	2,225,161,256.94
本报告期基金总申购份额	496,540,181.21
减:本报告期基金总赎回份额	1,448,370,483.35
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,273,330,954.80

§ 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

本报告期基金管理人的重大人事变动：

1、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。

2、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；

3、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；

4、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；

5、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并通过，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。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动：

本报告期内，交通银行股份有限公司（以下简称“本行”）因工作需要，刘树军先生不再担任本行资产托管业务中心总裁，任命袁庆伟女士为本行资产托管业务中心总裁。

袁庆伟女士的基金行业高级管理人员任职资格已在中国证券投资基金业协会备案。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。本年度应支付的审计费为人民币 100,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受任何稽查或处罚等情况。

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	
银河证券	1	3,669,171,890.68	26.86%	3,289,971.32	26.72%	-
兴业证券	1	2,288,688,705.05	16.76%	2,092,768.26	17.00%	-
东方证券	1	2,054,756,871.61	15.04%	1,871,501.84	15.20%	-
中信建投	1	1,519,387,573.62	11.12%	1,345,293.73	10.93%	-
民生证券	1	1,029,630,961.36	7.54%	918,440.59	7.46%	-
瑞银证券	1	990,240,158.29	7.25%	880,993.69	7.15%	-
国信证券	1	673,503,429.63	4.93%	607,315.43	4.93%	-
华泰证券	1	613,993,255.65	4.50%	560,323.52	4.55%	-
新时代证券	1	560,772,267.29	4.11%	512,129.22	4.16%	-
申万宏源	1	257,743,391.53	1.89%	234,650.50	1.91%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
中信万通	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

本报告期内交易单元无变更，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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 回购成交总 额的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
银河证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

新时代证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
中信万通	-	-	-	-	-	-

融通基金管理有限公司

二〇一六年三月三十日