

融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据融通新区域新经济灵活配置证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同规定，于 2016 年 8 月 22 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 2016 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
<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	10
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	11
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>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	15
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>29</b>
7.1 期末基金资产组合情况	29
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	30
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	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	32
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	36
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	36
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	36
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	36
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	36
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	36
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	37

<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>38</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	38
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 .....	38
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>38</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>38</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	38
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 .....	38
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	39
10.4 基金投资策略的改变 .....	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	39
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 .....	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	39
10.8 其他重大事件 .....	40
<b>§ 11 备查文件目录</b> .....	<b>41</b>

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	融通新区域新经济灵活配置混合
基金主代码	001152
前端交易代码	001152
后端交易代码	001153
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 20 日
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,261,907,628.26 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金按照“区域优势”和“战略性新兴产业”两条投资主线筛选符合条件的优质上市公司，分享中国区域经济增长和战略新兴产业发展中的投资机会，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的大类资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究，基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例，规避系统性风险。本基金对大类资产进行配置的策略为：在经济的复苏和繁荣期超配股票资产；在经济的衰退和政策刺激阶段，超配债券等固定收益类资产，力争通过资产配置获得部分超额收益。
业绩比较基准	中证新兴产业指数收益率×50%+中债综合（全价）指数收益率×50%
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和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	涂卫东	林葛
	联系电话	(0755) 26948666	(010) 66060069
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-883-8088、(0755) 26948088	95599

传真	(0755) 26935005	(010)68121816
注册地址	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518053	100031
法定代表人	高峰	周慕冰

## 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》、《证券时报》、《上海证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.rtfund.com">http://www.rtfund.com</a>
基金半年度报告备置地点	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(2016年1月1日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	-331,311,026.10
本期利润	-327,283,786.62
加权平均基金份额本期利润	-0.1413
本期加权平均净值利润率	-24.83%
本期基金份额净值增长率	-18.96%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	-1,125,919,813.58
期末可供分配基金份额利润	-0.4978
期末基金资产净值	1,343,812,382.84
期末基金份额净值	0.594
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-40.60%

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

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

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

利润（已实现部分扣除未实现部分）。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	8.79%	1.63%	0.83%	0.71%	7.96%	0.92%
过去三个月	3.48%	1.73%	-0.90%	0.70%	4.38%	1.03%
过去六个月	-18.96%	2.64%	-9.29%	1.16%	-9.67%	1.48%
过去一年	-29.03%	2.62%	-13.51%	1.42%	-15.52%	1.20%
自基金合同生效起至今	-40.60%	2.59%	-17.75%	1.47%	-22.85%	1.12%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

融通基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证监会证监基字[2001]8 号文批准，于 2001 年 5 月 22 日成立，公司注册资本 12500 万元人民币。本公司的股东及其出资比例为：新时

代证券股份有限公司 60%、日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co., Ltd.）40%。

截至 2016 年 6 月 30 日，公司管理的基金共有四十五只：一只封闭式基金，即融通通乾封闭基金；四十四只开放式基金，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、融通汇财宝货币市场基金、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、融通成长 30 混合基金、融通中国风 1 号混合基金、融通通盈保本混合基金、融通增利债券基金、融通增裕债券基金、融通增鑫债券基金、融通增益债券基金、融通增祥债券基金和融通新消费混合基金。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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨博琳	融通动力先锋混合型证券投资基金、融通内需驱动混合型证券投资基金、融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金	2015 年 5 月 20 日	-	5	杨博琳先生，北京大学金融学硕士、上海交通大学船舶与海洋工程学士，5 年证券投资从业经历，具有基金从业资格。历任华夏基金管理有限公司研究员、TMT 研究组长。2014 年 12 月加入融通基金管理有限公司，2015 年 3 月 28 日起至今任“融通动力先锋混合型证券投资基金”基金经理、2015 年 4 月 28 日起至今任“融通内需驱动混合型证券投资基金”基金经理、2015 年 5 月 20 日起至今任“融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金”基金经理。
刘格菘	融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)、融通互	2015 年 5 月 20 日	-	5	刘格菘先生，中国人民银行研究生部经济学博士、金融学硕士，东北财经大学国际金融学士，6 年证券投资从业经历，

	<p>联网传媒灵活配置混合型证券投资基金、融通新区新经济灵活配置混合型证券投资基金、融通新能源灵活配置混合型证券投资基金、融通成长 30 灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>			<p>具有基金从业资格，现任融通基金管理有限公司权益投资部总经理。曾任职于中国人民银行营业管理部，历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的基金经理。2014 年 9 月加入融通基金管理有限公司，2014 年 12 月 24 日起至今任“融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)”基金经理，2015 年 4 月 16 日起至今任“融通互联网传媒灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，2015 年 5 月 20 日起至今任“融通新区新经济灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，2015 年 6 月 29 日起至今任“融通新能源灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，2015 年 12 月 11 日起至今任“融通成长 30 灵活配置混合型证券投资基金”基金经理。</p>
--	--	--	--	---

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。

本基金管理人对报告期内不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析，各投资组合的同向交易价差均处于合理范围之内。

报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金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

2016 年上半年，资本市场经历了较大的变化，先是 1 月份的单边大幅下跌，经历了两次熔断，单月最大下跌幅度上证综指为 24.69%，创业板为 29.76%，1 月份所有板块均大幅下挫，其中以 TMT 行业下跌幅度居前，随后市场开始进入宽幅震荡期，并在 3 月底开始迎来结构性机会。二季度，上证综指下跌 2.47%，创业板指下跌 0.47%，沪深 300 下跌 1.99%。虽然各主要指数都没有太多表现，但期间主题较为活跃，如智能驾驶、互联网金融、新能源汽车、半导体、物联网、OLED 等主题较为活跃，黄金、白酒等板块个股不断创出新高，结构性机会较为明显。

本基金在 2015 年底进行了一轮减仓，但仍维持了较高仓位，并且持仓结构以中小创为主，因而在 1 月份市场大跌的过程中净值回撤较为严重，最大跌幅为 28.65%。

随后在市场开始宽幅震荡的时候，本基金也在不断优化持仓结构，在二季度重点增持了新能源汽车板块，将其作为今年的战略性板块进行底仓配置，同时精选了民参军个股，取得了一定的收益。另外，在市场低潮时，以一部分仓位作为战术性资产配置，选择位置较低的券商、TMT、物联网等个股，以绝对收益的思路，严格控制止盈止损，取得了一定的效果。

##### 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-18.96%，同期业绩比较基准收益率为-9.29%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们主要关注英国脱欧事件对全球带来的蝴蝶效应。好的方面是，全球范围内可能会带来新一轮的宽松，之前担心的美国加息有可能会进一步推迟，国内货币环境会持续的宽松。但同时应关注两个负面事件：1) 人民币汇率贬值的压力，如贬值超预期有可能会对资本市场带来一定的压力；2) 信用债事件爆发黑天鹅的可能性。

在当前点位上，我们将关注改革的进一步落地情况，若市场对改革落地超预期，或将有望带来新一轮行情。在此之前，市场大概率会维持震荡格局，维持之前的结构性行情。

#### 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、金融工程小组、登记清算部和监察稽核部指定人员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验，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及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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—融通基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本托管人认为，融通基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 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

本托管人认为，融通基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净

值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 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：融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	161,697,063.90	226,506,226.45
结算备付金		8,481,584.29	14,488,087.18
存出保证金		2,084,284.05	5,042,489.87
交易性金融资产	6.4.7.2	921,162,035.47	1,335,082,214.69
其中：股票投资		921,162,035.47	1,335,082,214.69
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		260,323,599.22	151,336,301.31
应收利息	6.4.7.5	38,963.42	53,631.16
应收股利		-	-
应收申购款		290,813.48	222,632.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,354,078,343.83	1,732,731,582.84
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 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		1,728,976.48	2,956,588.15
应付管理人报酬		1,619,889.43	2,263,149.89
应付托管费		269,981.58	377,191.62
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	6.4.7.7	6,443,687.78	5,970,419.07
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	203,425.72	111,755.90
负债合计		10,265,960.99	11,679,104.63
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,261,907,628.26	2,348,993,316.54
未分配利润	6.4.7.10	-918,095,245.42	-627,940,838.33
所有者权益合计		1,343,812,382.84	1,721,052,478.21
负债和所有者权益总计		1,354,078,343.83	1,732,731,582.84

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.594 元，基金份额总额 2,261,907,628.26 份。

## 6.2 利润表

会计主体：融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 5 月 20 日(基 金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-299,633,101.43	-500,722,916.37
1. 利息收入		978,921.78	1,512,240.81
其中：存款利息收入	6.4.7.11	978,921.78	1,512,240.81
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		-304,793,925.66	-87,481,194.03
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-307,136,539.21	-89,743,949.11
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
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	2,342,613.55	2,262,755.08
3. 公允价值变动收益	6.4.7.17	4,027,239.48	-415,303,195.71
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	6.4.7.18	154,662.97	549,232.56
<b>减：二、费用</b>		27,650,685.19	9,305,160.94

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,866,130.04	5,257,510.69
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,644,355.00	876,251.76
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	15,922,928.49	3,123,095.42
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	217,271.66	48,303.07
<b>三、利润总额</b>		-327,283,786.62	-510,028,077.31
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润</b>		-327,283,786.62	-510,028,077.31

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	2,348,993,316.54	-627,940,838.33	1,721,052,478.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-327,283,786.62	-327,283,786.62
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-87,085,688.28	37,129,379.53	-49,956,308.75
其中：1. 基金申购款	62,465,753.31	-26,420,372.98	36,045,380.33
2. 基金赎回款	-149,551,441.59	63,549,752.51	-86,001,689.08
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）	2,261,907,628.26	-918,095,245.42	1,343,812,382.84
项目	上年度可比期间 2015 年 5 月 20 日（基金合同生效日）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）	3,161,231,163.54	-	3,161,231,163.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本	-	-510,028,077.31	-510,028,077.31

期利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-152,358,159.81	18,785,304.57	-133,572,855.24
其中：1. 基金申购款	13,286,137.31	-1,452,664.11	11,833,473.20
2. 基金赎回款	-165,644,297.12	20,237,968.68	-145,406,328.44
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)	3,008,873,003.73	-491,242,772.74	2,517,630,230.99

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：

<u>孟朝霞</u>	<u>颜锡廉</u>	<u>刘美丽</u>
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

融通新区域新经济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[2015]353号《关于准予融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》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《通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币3,160,170,139.76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(2015)第546号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年5月20日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为3,161,231,163.54份基金份额,其中认购资金利息折合1,061,023.78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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、股指期货、权证等权益类金融工具,债券等固定收益类金融工具(包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)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相关规定)。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的0%-95%,

其余资产投资于债券、货币市场工具、资产支持证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；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；在扣除股指期货需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金投资于新区域新经济相关上市公司的证券资产合计不低于非现金基金资产的 80%。本基金的业绩比较基准为：中证新兴产业指数收益率×50% + 中债综合(全价)指数收益率×50%。

#### 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金 基金合同》和中国证监会、中国基金业协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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 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、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2015]101 号《关于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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前, 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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起, 金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税, 对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入, 应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额, 自 2015 年 9 月 8 日起, 暂免征收个人所得税。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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	161,697,063.90
定期存款	-
其中: 存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计:	161,697,063.90

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	821,273,326.09	921,162,035.47	99,888,709.38
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-

	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	821,273,326.09	921,162,035.47	99,888,709.38

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/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

本基金本报告期末各项买入返售金融资产余额均为零。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中所取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	34,208.72
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3,816.70
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	938.00
合计	38,963.42

#### 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 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	6,443,687.78
银行间市场应付交易费用	-
合计	6,443,687.78

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,519.74
预提费用	198,905.98
合计	203,425.72

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,348,993,316.54	2,348,993,316.54
本期申购	62,465,753.31	62,465,753.31
本期赎回	-149,551,441.59	-149,551,441.59
本期末	2,261,907,628.26	2,261,907,628.26

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

## 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	-836,575,787.50	208,634,949.17	-627,940,838.33
本期利润	-331,311,026.10	4,027,239.48	-327,283,786.62
本期基金份额交易产生的变动数	41,967,000.02	-4,837,620.49	37,129,379.53
其中：基金申购款	-27,701,698.88	1,281,325.90	-26,420,372.98
基金赎回款	69,668,698.90	-6,118,946.39	63,549,752.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,125,919,813.58	207,824,568.16	-918,095,245.42

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	882,533.31
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	64,744.80
其他	31,643.67
合计	978,921.78

## 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	5,335,767,685.91
减：卖出股票成本总额	5,642,904,225.12
买卖股票差价收入	-307,136,539.21

## 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

## 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。

## 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

## 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,342,613.55
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,342,613.55

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	4,027,239.48
——股票投资	4,027,239.48
——债券投资	-
——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	4,027,239.48

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
----	----------------------------

基金赎回费收入	122,215.03
转换费收入	32,447.94
-	-
合计	154,662.97

- 注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减。不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产；  
2、基金转换收取转换费和补差费，其中不低于转换费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	15,922,928.49
银行间市场交易费用	-
合计	15,922,928.49

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	49,726.04
信息披露费	149,179.94
银行费用	9,365.68
债券帐户维护费	9,000.00
其他	-
合计	217,271.66

#### 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

截止资产负债表日，本基金无需作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需要作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
中国农业银行	基金托管人、基金代销机构
新时代股份有限公司（“新时代证券”）	基金管理人股东、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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
新时代证券	540,064,336.10	5.11%

##### 6.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016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	492,161.30	5.10%	390,850.89	6.07%

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后的净额列示。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 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年5月20日(基金合同生效 日)至2015年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	9,866,130.04
其中：支付销售机构的客户维护费	5,477,199.94	2,897,474.82

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：日管理人报酬 = 前一日基金资产

净值×1.50% / 当年天数。

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

#### 6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年5月20日(基金合同生效日)至2015年6月30日	
当期发生的基金应支付的托管费	1,644,355.00		876,251.76	

注：支付基金托管人中国农业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。

#### 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

本基金本报告期末及上年度可比期间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

本报告期基金管理人及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，基金管理人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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年5月20日(基金合同生效日)至2015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
中国农业银行	161,697,063.90	882,533.31	1,348,964,462.16	1,499,016.10

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，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、本基金本报告期末未买入管理人、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、本基金本报告期末买入管理人、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

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
002127	南极电商	2016年5月16日	重大资产重组	10.05	-	-	7,067,322	60,609,866.96	71,026,586.10	-
601599	鹿港科技	2016年4月11日	重大事项	10.94	2016年7月6日	10.21	886,304	9,257,065.18	9,696,165.76	-

注：本基金截至2016年6月30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。

##### 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。

###### 6.4.12.3.2 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。

#### 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

本基金是混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风

险。本基金的基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行建设全面风险管理体系、风控优先的政策，在董事会下设立合规与审计委员会，负责检查公司合规运作的状况及合规控制的有效性，并对公司的合规控制提出相关要求；在管理层层面设立风险控制委员会，负责建立健全公司的风险管理制度并组织实施，审定公司的业务风险管理政策，审定公司内控管理组织实施方案，审定公司的业务授权方案，审定基金资产组合的风险状况评价分析报告，审定公司各项风险与内控状况评价报告，审定业务风险损失责任人的责任，审定重大业务可行性风险论证，协调突发性重大风险事件的处理；各业务部门在执行业务事项时需遵守相关法律法规，遵守公司业务管理制度，具有根据业务特点控制业务风险的职责。业务人员是风险控制环节的第一责任人，部门负责人是控制业务风险管理的第一责任人，对部门风险控制措施的实施情况进行管理；风险管理小组由投资经理、金融工程人员和研究员组成，负责制定相关业务风险的识别和度量方法，指导业务部门实施风险的管理和控制，并定期出具投资组合风险报告，进行投资风险分析与绩效评估；督察长和监察稽核部负责监察公司各业务部门在相关法律法规、规章制度和业务流程执行方面的情况，确保既定的风险控制措施得到有效的贯彻执行，发现内控缺失和管理漏洞，提出改进要求和建议，并报告法规和制度的执行情况。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，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 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。

#### 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。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余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 2016 年 6 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 2016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	161,697,063.90	-	-	-	161,697,063.90
结算备付金	8,481,584.29	-	-	-	8,481,584.29
存出保证金	2,084,284.05	-	-	-	2,084,284.05
交易性金融资产	-	-	-	921,162,035.47	921,162,035.47
应收证券清算款	-	-	-	260,323,599.22	260,323,599.22
应收利息	-	-	-	38,963.42	38,963.42
应收申购款	-	-	-	290,813.48	290,813.48
资产总计	172,262,932.24	-	-	1,181,815,411.59	1,354,078,343.83
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,728,976.48	1,728,976.48
应付管理人报酬	-	-	-	1,619,889.43	1,619,889.43
应付托管费	-	-	-	269,981.58	269,981.58
应付交易费用	-	-	-	6,443,687.78	6,443,687.78
其他负债	-	-	-	203,425.72	203,425.72
负债总计	-	-	-	10,265,960.99	10,265,960.99
利率敏感度缺口	172,262,932.24	-	-	1,171,549,450.60	1,343,812,382.84
上年度末 2015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	226,506,226.45	-	-	-	226,506,226.45
结算备付金	14,488,087.18	-	-	-	14,488,087.18
存出保证金	5,042,489.87	-	-	-	5,042,489.87
交易性金融资产	-	-	-	1,335,082,214.69	1,335,082,214.69
应收证券清算款	-	-	-	151,336,301.31	151,336,301.31
应收利息	-	-	-	53,631.16	53,631.16
应收申购款	-	-	-	222,632.18	222,632.18

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	246,036,803.50	-	-	1,486,694,779.34	1,732,731,582.84
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,956,588.15	2,956,588.15
应付管理人报酬	-	-	-	2,263,149.89	2,263,149.89
应付托管费	-	-	-	377,191.62	377,191.62
应付交易费用	-	-	-	5,970,419.07	5,970,419.07
其他负债	-	-	-	111,755.90	111,755.90
负债总计	-	-	-	11,679,104.63	11,679,104.63
利率敏感度缺口	246,036,803.50	-	-	1,475,015,674.71	1,721,052,478.21

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 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，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的股票，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，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的 0%-95%，其余资产投资于债券、货币市场工具、资产支持证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；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；在扣除股指期货需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	921,162,035.47	68.55	1,335,082,214.69	77.57
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
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	921,162,035.47	68.55	1,335,082,214.69	77.57

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证新兴指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额	
		本期末(2016 年 6 月 30 日)	上年度末(2015 年 12 月 31 日)
	中证新兴指数上升 5%	72,051,080.14	—
	中证新兴指数下降 5%	-72,051,080.14	—

注：于 2015 年 12 月 31 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

#### 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	921,162,035.47	68.03

	其中：股票	921,162,035.47	68.03
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	170,178,648.19	12.57
7	其他各项资产	262,737,660.17	19.40
8	合计	1,354,078,343.83	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	7,065,457.75	0.53
B	采矿业	-	-
C	制造业	544,969,343.40	40.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	40,215,550.86	2.99
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	14,790,438.48	1.10
G	交通运输、仓储和邮政业	53,997,689.86	4.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	61,815,423.38	4.60
J	金融业	1,581,701.04	0.12
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	71,026,586.10	5.29
M	科学研究和技术服务业	114,453,332.10	8.52
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	11,246,512.50	0.84

合计	921,162,035.47	68.55
----	----------------	-------

## 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	300008	天海防务	3,437,037	114,453,332.10	8.52
2	300340	科恒股份	1,126,769	89,273,907.87	6.64
3	300073	当升科技	1,166,729	78,100,839.26	5.81
4	002127	南极电商	7,067,322	71,026,586.10	5.29
5	600110	诺德股份	6,427,865	63,250,191.60	4.71
6	600419	天润乳业	859,910	46,340,549.90	3.45
7	002245	澳洋顺昌	3,624,378	46,283,307.06	3.44
8	300310	宜通世纪	1,081,980	41,320,816.20	3.07
9	002108	沧州明珠	1,580,912	40,945,620.80	3.05
10	002479	富春环保	3,581,082	40,215,550.86	2.99
11	300021	大禹节水	2,111,846	39,787,178.64	2.96
12	600006	东风汽车	3,726,701	33,055,837.87	2.46
13	002547	春兴精工	2,843,218	31,445,991.08	2.34
14	300202	聚龙股份	1,024,549	24,804,331.29	1.85
15	300467	迅游科技	327,200	20,247,136.00	1.51
16	600386	北巴传媒	792,628	14,790,438.48	1.10
17	600519	贵州茅台	49,417	14,425,810.64	1.07
18	002022	科华生物	631,200	13,450,872.00	1.00
19	000858	五粮液	413,265	13,443,510.45	1.00
20	300014	亿纬锂能	309,700	13,375,943.00	1.00
21	002444	巨星科技	656,450	13,339,064.00	0.99
22	000034	神州数码	499,845	11,246,512.50	0.84
23	601599	鹿港科技	886,304	9,696,165.76	0.72
24	002357	富临运业	499,960	7,714,382.80	0.57
25	002458	益生股份	161,275	7,065,457.75	0.53
26	002157	正邦科技	294,377	6,906,084.42	0.51
27	300054	鼎龙股份	199,833	4,999,821.66	0.37
28	000021	深科技	381,458	4,199,852.58	0.31
29	600552	凯盛科技	100,000	2,024,000.00	0.15
30	002673	西部证券	61,164	1,581,701.04	0.12
31	002709	天赐材料	7,492	523,990.48	0.04
32	300259	新天科技	41,192	520,254.96	0.04
33	300007	汉威电子	13,900	388,088.00	0.03

34	603898	好莱客	10,000	310,900.00	0.02
35	002533	金杯电工	20,200	271,286.00	0.02
36	300168	万达信息	6,182	160,670.18	0.01
37	600570	恒生电子	1,300	86,801.00	0.01
38	600232	金鹰股份	6,006	79,219.14	0.01
39	300078	思创医惠	300	10,032.00	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	300073	当升科技	157,226,324.29	9.14
2	300364	中文在线	108,861,575.58	6.33
3	300340	科恒股份	103,321,969.04	6.00
4	300078	思创医惠	88,196,994.93	5.12
5	601688	华泰证券	79,908,628.63	4.64
6	600219	南山铝业	68,726,182.63	3.99
7	002410	广联达	67,161,871.31	3.90
8	300168	万达信息	66,706,831.99	3.88
9	002709	天赐材料	66,176,465.84	3.85
10	300263	隆华节能	64,968,922.07	3.77
11	002517	恺英网络	61,339,862.35	3.56
12	600110	诺德股份	58,238,218.61	3.38
13	002108	沧州明珠	57,979,439.78	3.37
14	002640	跨境通	57,756,482.62	3.36
15	002537	海立美达	57,467,728.68	3.34
16	300202	聚龙股份	55,384,953.61	3.22
17	600386	北巴传媒	54,291,929.05	3.15
18	300007	汉威电子	53,867,991.29	3.13
19	002245	澳洋顺昌	49,427,576.45	2.87
20	300253	卫宁健康	48,809,967.26	2.84
21	300467	迅游科技	48,300,327.44	2.81
22	600622	嘉宝集团	48,151,184.16	2.80
23	300141	和顺电气	47,550,903.32	2.76
24	600115	东方航空	45,236,287.94	2.63

25	002551	尚荣医疗	44,145,035.29	2.57
26	300008	天海防务	43,365,110.53	2.52
27	000700	模塑科技	43,043,967.54	2.50
28	600476	湘邮科技	42,830,375.00	2.49
29	300014	亿纬锂能	42,107,766.49	2.45
30	600029	南方航空	41,920,159.75	2.44
31	300310	宜通世纪	41,850,904.83	2.43
32	600419	天润乳业	41,784,256.95	2.43
33	600198	大唐电信	41,765,253.58	2.43
34	600485	信威集团	41,662,530.95	2.42
35	002165	红宝丽	41,282,170.36	2.40
36	600730	中国高科	40,800,733.83	2.37
37	002533	金杯电工	40,551,469.20	2.36
38	002547	春兴精工	40,112,668.27	2.33
39	300336	新文化	40,100,091.84	2.33
40	300352	北信源	39,982,856.57	2.32
41	300027	华谊兄弟	39,943,486.68	2.32
42	000793	华闻传媒	39,865,279.41	2.32
43	600075	新疆天业	39,784,680.66	2.31
44	000783	长江证券	39,653,896.35	2.30
45	002479	富春环保	39,547,615.19	2.30
46	300101	振芯科技	39,533,103.29	2.30
47	002271	东方雨虹	39,492,828.80	2.29
48	600446	金证股份	39,489,688.80	2.29
49	002224	三力士	39,366,586.21	2.29
50	300085	银之杰	39,112,639.94	2.27
51	002358	森源电气	38,988,776.66	2.27
52	000626	如意集团	38,974,617.28	2.26
53	002313	日海通讯	38,824,351.57	2.26
54	300259	新天科技	38,740,505.65	2.25
55	002264	新华都	38,623,233.67	2.24
56	300098	高新兴	38,520,121.11	2.24
57	601689	拓普集团	37,934,532.47	2.20
58	300075	数字政通	37,874,419.78	2.20
59	600221	海南航空	37,465,564.60	2.18
60	002094	青岛金王	37,331,005.35	2.17

61	601777	力帆股份	37,300,717.94	2.17
62	300431	暴风集团	36,262,857.48	2.11
63	300153	科泰电源	35,750,045.49	2.08
64	300166	东方国信	35,419,412.56	2.06
65	300088	长信科技	35,220,443.26	2.05
66	002468	艾迪西	34,786,401.92	2.02
67	000606	*ST 易桥	34,646,764.68	2.01

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	300364	中文在线	111,698,213.24	6.49
2	300202	聚龙股份	98,061,513.95	5.70
3	600446	金证股份	91,557,689.64	5.32
4	002085	万丰奥威	87,722,274.54	5.10
5	300073	当升科技	85,749,434.54	4.98
6	002599	盛通股份	79,056,395.58	4.59
7	601688	华泰证券	77,938,380.00	4.53
8	600485	信威集团	76,999,193.57	4.47
9	600219	南山铝业	75,171,952.31	4.37
10	300078	思创医惠	73,379,582.07	4.26
11	002343	慈文传媒	72,804,269.96	4.23
12	002709	天赐材料	72,617,910.23	4.22
13	002667	鞍重股份	72,261,660.33	4.20
14	002410	广联达	69,401,598.32	4.03
15	002640	跨境通	68,835,060.64	4.00
16	002517	恺英网络	67,979,475.30	3.95
17	300025	华星创业	67,665,484.05	3.93
18	300168	万达信息	66,232,257.22	3.85
19	300008	天海防务	62,399,230.62	3.63
20	002537	海立美达	60,385,500.45	3.51
21	000606	*ST 易桥	58,178,609.12	3.38
22	300007	汉威电子	57,098,664.56	3.32
23	300263	隆华节能	55,823,382.13	3.24
24	300141	和顺电气	55,537,711.95	3.23
25	300253	卫宁健康	51,214,901.37	2.98

26	600622	嘉宝集团	50,431,755.88	2.93
27	300153	科泰电源	50,148,763.34	2.91
28	300342	天银机电	49,836,617.02	2.90
29	300075	数字政通	45,713,921.80	2.66
30	300467	迅游科技	44,837,913.95	2.61
31	002165	红宝丽	43,694,455.64	2.54
32	600115	东方航空	43,403,381.38	2.52
33	600476	湘邮科技	43,348,237.08	2.52
34	000783	长江证券	42,486,174.98	2.47
35	300098	高新兴	40,832,238.03	2.37
36	300085	银之杰	40,685,218.82	2.36
37	600386	北巴传媒	40,458,023.60	2.35
38	300259	新天科技	40,395,809.93	2.35
39	002094	青岛金王	40,357,192.83	2.34
40	002271	东方雨虹	40,342,561.80	2.34
41	300340	科恒股份	39,946,457.17	2.32
42	300014	亿纬锂能	39,926,657.91	2.32
43	600730	中国高科	39,170,419.31	2.28
44	300088	长信科技	39,131,333.78	2.27
45	000626	如意集团	38,562,607.02	2.24
46	300101	振芯科技	38,525,272.75	2.24
47	000700	模塑科技	38,521,229.50	2.24
48	600029	南方航空	38,354,371.35	2.23
49	002224	三力士	38,255,521.55	2.22
50	600198	大唐电信	38,156,580.22	2.22
51	000985	大庆华科	37,821,425.80	2.20
52	002551	尚荣医疗	37,643,281.76	2.19
53	601777	力帆股份	37,122,636.09	2.16
54	002533	金杯电工	37,117,677.08	2.16
55	600221	海南航空	36,486,127.60	2.12
56	002313	日海通讯	36,292,040.80	2.11
57	300027	华谊兄弟	36,186,374.41	2.10
58	000421	南京公用	36,154,885.92	2.10
59	600075	新疆天业	36,106,015.39	2.10
60	002316	键桥通讯	35,831,454.62	2.08
61	000793	华闻传媒	35,544,381.76	2.07
62	300336	新文化	35,428,227.47	2.06
63	300431	暴风集团	35,394,176.49	2.06

64	002264	新华都	34,454,927.12	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。

#### 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	5,224,956,806.42
卖出股票收入（成交）总额	5,335,767,685.91

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。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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投资股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**7.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注****7.12.1**

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

**7.12.2**

本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,084,284.05
2	应收证券清算款	260,323,599.22
3	应收股利	-
4	应收利息	38,963.42
5	应收申购款	290,813.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	262,737,660.17

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

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	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002127	南极电商	71,026,586.10	5.29	重大事项停牌

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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
30,177	74,954.69	4,513,968.12	0.20%	2,257,393,660.14	99.80%

### 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	373,275.43	0.0165%

### 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、基金投资和研发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	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年5月20日)基金份额总额	3,161,231,163.54
本报告期期初基金份额总额	2,348,993,316.54
本报告期基金总申购份额	62,465,753.31
减:本报告期基金总赎回份额	149,551,441.59
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,261,907,628.26

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内,基金管理人无重大人事变更。

#### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,专门基金托管部门无重大人事变更。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

### 10.4 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。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，该事务所自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，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。

### 10.7 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	
东兴证券	1	11,264,089,157.43	11.97%	1,151,966.38	11.94%	-
国泰君安	1	93,894,791.32	0.89%	85,566.63	0.89%	-
海通证券	2	22,347,673,267.62	22.23%	2,139,432.93	22.17%	-
申万宏源	1	3,950,031,017.94	37.40%	3,599,665.79	37.30%	-
新时代证券	1	540,064,336.10	5.11%	492,161.30	5.10%	-
招商证券	1	11,048,618,811.49	9.93%	955,608.46	9.90%	-
中信证券	1	11,316,353,110.43	12.46%	1,225,920.32	12.70%	-

注：（1）本基金选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的标准包括以下六个方面：

- 1) 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- 2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- 3) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；
- 4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- 5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

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

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

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

(3) 本基金本报告期交易单元无变化。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

#### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	披露方式	披露日期
1	融通基金管理有限公司关于上海证券交易所、深圳证券交易所及中国金融期货交易所指数熔断的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-1-4
2	融通基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-1-6
3	融通基金管理有限公司关于上海证券交易所、深圳证券交易所及中国金融期货交易所指数熔断的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-1-7
4	关于深圳富济财富管理有限公司开通融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金定期定额投资业务及参加费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-1-18
5	关于国信证券股份有限公司新增销售融通基金管理有限公司旗下部分基金及开通基金“定期定额投资业务”的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-2-17
6	融通基金管理有限公司关于参加上海陆金所资产管理有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-3-7
7	融通基金管理有限公司关于参加数米基金网费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-3-9
8	融通基金管理有限公司关于公司从业人员在子公司兼职情况的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-3-12
9	融通关于旗下部分开放式基金新增代销机构并参加其申购费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、管理人网站	2016-3-24

10	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构并参加其申购费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、管理人网站	2016-3-24
11	关于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、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-3-31
12	融通基金管理有限公司关于参加上海陆金所资产管理有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-4-20
13	关于北京晟视天下投资管理有限公司新增销售融通基金管理有限公司旗下部分基金的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-4-22
14	融通基金管理有限公司关于调整招商银行借记卡网上直销费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-4-25
15	融通基金管理有限公司关于对通过本公司直销中心赎回公司旗下部分基金的养老金客户实施特定赎回费率的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-5-9
16	关于融通基金管理有限公司旗下开放式基金新增奕丰金融服务（深圳）有限公司为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-5-13
17	融通基金管理有限公司关于上海证券交易所、深圳证券交易所及中国金融期货交易所指数熔断的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-1-7
18	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金在深圳市新兰德证券投资咨询有限公司开通定期定额投资业务及参加基金申购费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-5-24
19	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增苏州银行股份有限公司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、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-6-17
20	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增上海好买基金销售有限公司为代销机构并参加其申购费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-6-20
21	关于融通基金管理有限公司旗下开放式基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定期定额投资业务并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2016-6-24

## § 11 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- (五) 《融通基金管理有限公司开放式基金业务管理规则》

(六) 融通基金管理有限公司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

存放地点：基金管理人、基金托管人处

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 <http://www.rtfund.com> 查询。