

融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金
(原通乾证券投资基金)
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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

通乾证券投资基金的基金管理人融通基金管理有限公司于 2016 年 7 月 8 日发布公告《关于通乾证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，经持有人大会决议通过并报中国证监会备案，获得上海证券交易所同意，通乾证券投资基金终止上市日为 2016 年 8 月 12 日，自融通通乾证券投资基金终止上市之日起，由《通乾证券投资基金基金合同》修订而成的《融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》正式生效。至本半年度报告截止日 2016 年 6 月 30 日，通乾证券投资基金仍然合同生效，所以本半年度报告仍以通乾证券投资基金（以下简称“本基金”）为主体进行编制，敬请投资者留意。

本基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据通乾证券投资基金基金合同规定，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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	31
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	33
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	35
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	35
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	35
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	35
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	35
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	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	36

§ 8 基金份额持有人信息	37
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	37
8.2 期末上市基金前十名持有人	37
§ 9 重大事件揭示	37
9.1 基金份额持有人大会决议	37
9.2 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
9.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	38
9.4 基金投资策略的改变	38
9.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	38
9.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	38
9.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	38
9.8 其他重大事件	40
§ 10 影响投资者决策的其他重要信息	40
§ 11 备查文件目录	41

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	通乾证券投资基金
基金简称	融通通乾封闭
基金主代码	500038
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2001 年 8 月 29 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	2,000,000,000.00 份
基金合同存续期	2001 年 8 月 29 日至 2016 年 8 月 11 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2001 年 9 月 21 日

注：2016 年 6 月 8 日至 2016 年 7 月 6 日期间，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议了《关于通乾证券投资基金转型有关事项的议案》。本次基金份额持有人大会于 2016 年 7 月 7 日表决通过了《关于通乾证券投资基金转型有关事项的议案》，本次持有人大会决议报中国证监会备案，并自该日起生效。基金管理人向上海证券交易所申请基金终止上市，并已获得上海证券交易所同意（上海证券交易所自律监管决定书[2016]193 号文），本基金终止上市日为 2016 年 8 月 12 日。自本基金终止上市之日起，由《通乾证券投资基金基金合同》修订而成的《融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》正式生效。本基金正式转型为开放式基金，存续期限调整为不定期，基金投资目标、范围和策略予以调整，同时更名为“融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金”，基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利义务关系以《融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》为准。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金属于价值成长型基金，主要投资于具有一定竞争优势、业绩能够持续增长或具有增长潜力的成长型上市公司股票，同时兼顾价值型公司股票。通过组合投资，在有效分散和控制风险的前提下，谋求基金资产的稳定增长。
投资策略	以价值成长型投资为主导，把企业的内在价值和未来成长能力作为选择投资对象的最核心标准。重视对趋势的把握，顺势而为，灵活操作。

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
注册地址	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层		北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层		北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518053		100033
法定代表人	高峰		王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处、上海证券交易所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司上海分公司	上海市陆家嘴东路 166 号中国保险大厦

§ 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	-328,237,007.64
本期利润	-393,262,294.33
加权平均基金份额本期利润	-0.1966
本期加权平均净值利润率	-15.61%
本期基金份额净值增长率	-11.09%
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	-206,511,464.45
期末可供分配基金份额利润	-0.1033
期末基金资产净值	1,856,873,637.08
期末基金份额净值	0.9284
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	515.12%

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）。

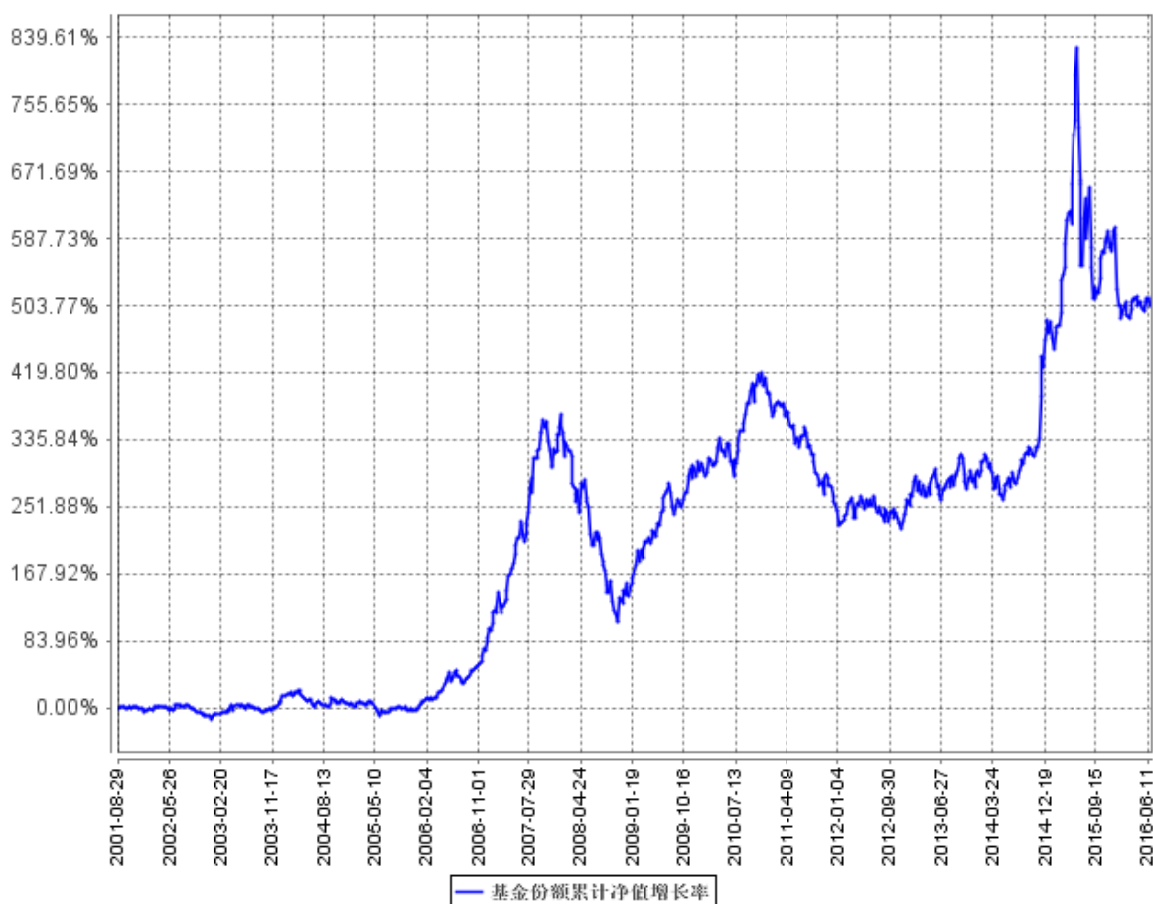
3.2 基金净值表现

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	3.16%	1.64%	-	-	-	-
过去三个月	0.44%	1.22%	-	-	-	-
过去六个月	-11.09%	2.43%	-	-	-	-
过去一年	-18.65%	3.76%	-	-	-	-
过去三年	69.98%	3.40%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	515.12%	2.89%	-	-	-	-

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（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
张延闯	本基金、融通转型三动力灵活配置混合的基金经理	2014 年 10 月 25 日	-	5	张延闯先生，哈尔滨工业大学工学硕士、工学学士，6 年证券投资从业经历，具有基金从业资格。2010 年 2 月加入融通基金管理有限公司，2014 年 10 月 25 日起至任“通乾证券投资基金”基金经理，2015 年 1 月 16 日起至任“融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金”基金经理。
郭鹏	本基金的基金经理	2015 年 1 月 6 日	2016 年 5 月 14 日	9	经济学硕士，具有基金从业资格。2006 年 4 月至 2007 年 12 月，在渤海证券从事证券研究工作；2007 年 12 月至 2010 年 4 月，在新华资产管理股份有限公司，从事证券研究和投资工作；2010 年 4 月至 2012 年 9 月，在宏源证券从事证券投资工作；2012 年 9 月至 2014 年 9 月，在齐鲁证券有限公司北京证券资产管理分公司，任执行总经理；2014 年 10 月加入融通基金管理有限公司，从事研究工作。

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

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，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

基于对市场不确定性的判断以及分红对流动性的要求，本基金在“熔断”期间大幅减仓，并且在报告期内始终保持较低的仓位。基金持仓结构较年初减持了农业、TMT 和军工板块，加仓了食品饮料、零售、中药。其中食品饮料中的白酒板块获得了较好的绝对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内基金份额净值增长率为-11.09%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场在不到一年时间跌幅达到 50%，但我们关注的核心变量“估值压力”仍然没有显著化解。除上证指数外，其他核心指数静态估值仍然较历史平均高 25%以上。盈利能力持续下滑的背景下，市场需要更长的时间消化估值。

今年以来通乾的投资做出了一些变化，策略上遵循逆向选股，并根据当下的宏观环境选择风险收益比合适的资产组合。目前重仓持有品牌消费品和零售，原因为一方面这些行业龙头企业相对估值合理，另一方面行业竞争格局的变化对其产生了一些有利的影响。

我们配置白酒的原因主要有三点。第一，三公消费的压力测试反应出真实的民间需求；其次，行业调整时期伴随着消费者偏好品牌升级，部分中低端白酒品牌存在跨区域扩张的机会；第三，品牌价值可以长期战胜通胀。

另外，这个季度也大幅增加了线下超市的配置，主要基于市场对该行业的判断有重大偏差。首先，线上的经营效率并不一定好于线下。考虑到仓储物流成本、员工社保支出、税收等因素，电商平台的盈亏平衡点甚至会更高。其次，随着资本市场降温，利用股东的钱在所有品类对线下价格战的能力正大幅削弱，而线下低成本采购商品的优势反而体现出来。第三，中国的社零总额超过 20 万亿，每年仍然保持 2 位数以上的增长，线下占比超过 85%，这里面存在巨大的行业整合机会。最后，我们理解零售的本质是“经营商品的能力”，互联网只是应用手段。零售业正在酝酿重大转型，渠道价值可能会被重估。

除了上述两个行业，基于产业集中度提升的思路，我们现在关注的其他资产包括 CRO、检验检测、中药、药店连锁、金融、光器件、工业自动化等行业。目前没有仓位重点体现，主要是在等待一个中长期回报合理的价格。

最后，封闭式基金转型的工作将在 8 月份完成。届时随着规模稳定基金仓位将稳中有升。基金管理也会淡化指数贝塔，侧重个股和行业阿尔法。

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及其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

本基金管理人于 2016 年 4 月 22 日实施利润分配，以 2015 年 12 月 31 日的可分配收益为基准，每 10 份基金份额派发现金红利 5.54 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，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，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，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。

本报告期内，融通通乾证券投资基金实施利润分配的金额为 1,107,999,998.42 元。

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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：通乾证券投资基金

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
资产：			

银行存款	6.4.7.1	19,685,364.82	24,850,054.99
结算备付金		3,989,253.60	7,085,742.47
存出保证金		1,706,507.10	1,915,772.30
交易性金融资产	6.4.7.2	1,824,226,121.57	3,276,353,813.55
其中：股票投资		884,530,121.57	2,293,004,813.55
基金投资		-	-
债券投资		939,696,000.00	983,349,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	42,319,235.56
应收利息	6.4.7.5	13,404,847.94	23,399,535.54
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	1,416,000.00	-
资产总计		1,864,428,095.03	3,375,924,154.41
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	5,386,800.54
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,259,298.93	4,255,793.38
应付托管费		376,549.81	709,298.88
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,809,464.17	4,507,655.84
应交税费		1,830,675.94	1,830,675.94
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,278,469.10	1,098,000.00
负债合计		7,554,457.95	17,788,224.58
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未分配利润	6.4.7.10	-143,126,362.92	1,358,135,929.83
所有者权益合计		1,856,873,637.08	3,358,135,929.83
负债和所有者权益总计		1,864,428,095.03	3,375,924,154.41

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9284 元，基金份额总额 2,000,000,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：通乾证券投资基金

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 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-358,203,411.76	853,718,225.97
1. 利息收入		18,979,876.98	14,450,511.01
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,096,228.00	445,733.11
债券利息收入		17,668,261.29	13,895,283.84
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		215,387.69	109,494.06
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		-312,158,002.05	1,346,339,689.71
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-332,035,798.14	1,336,728,908.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	14,697,787.40	3,037,029.41
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	5,180,008.69	6,573,751.98
3. 公允价值变动收益	6.4.7.17	-65,025,286.69	-507,071,974.75
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	6.4.7.18	-	-
减：二、费用		35,058,882.57	50,726,573.42
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	18,770,932.26	24,942,164.78
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,159,564.72	4,157,027.47
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	11,236,356.02	20,763,523.48
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	1,892,029.57	863,857.69
三、利润总额		-393,262,294.33	802,991,652.55
减：所得税费用		-	-
四、净利润		-393,262,294.33	802,991,652.55

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：通乾证券投资基金

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）	2,000,000,000.00	1,358,135,929.83	3,358,135,929.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-393,262,294.33	-393,262,294.33
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-1,107,999,998.42	-1,107,999,998.42
五、期末所有者权益（基金净值）	2,000,000,000.00	-143,126,362.92	1,856,873,637.08
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,000,000,000.00	1,267,283,888.78	3,267,283,888.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	802,991,652.55	802,991,652.55
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-400,000,000.00	-400,000,000.00
五、期末所有者权益（基金净值）	2,000,000,000.00	1,670,275,541.33	3,670,275,541.33

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

孟朝霞

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

通乾证券投资基金(简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)证监基金字[2001]25号文件《关于同意通乾证券投资基金设立及通宝证券投资基金上市扩募并续期的批复》批准,由河北证券有限责任公司、陕西省国际信托投资股份有限公司和融通基金管理有限公司作为发起人共同发起并向社会募集设立,基金合同于2001年8月29日生效,首次设立募集规模为20亿份基金份额。本基金为契约型封闭式,存续期为15年。本基金于2001年9月21日正式在上海证券交易所上市。本基金管理人为融通基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(简称“中国建设银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《通乾证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,其股票投资部分将主要投资于成长型股票和价值型股票。本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的80%,投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的20%。

2016年6月8日至2016年7月6日期间,本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会,审议了《关于通乾证券投资基金转型有关事项的议案》。本次基金份额持有人大会于2016年7月7日表决通过了《关于通乾证券投资基金转型有关事项的议案》,本次持有人大会决议报中国证监会备案,并自该日起生效。基金管理人向上海证券交易所申请基金终止上市,并已获得上海证券交易所同意(上海证券交易所自律监管决定书[2016]193号文),本基金终止上市日为2016年8月12日。自本基金终止上市之日起,由《通乾证券投资基金基金合同》修订而成的《融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》正式生效。本基金正式转型为开放式基金,存续期限调整为不定期,基金投资目标、范围和策略予以调整,同时更名为“融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金”,基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利义务关系以《融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》为准。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《通乾证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》、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	19,685,364.82
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	19,685,364.82

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	827,515,730.04	884,530,121.57	57,014,391.53
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	49,965,000.00	49,995,000.00
	银行间市场	883,360,290.00	889,701,000.00
	合计	933,325,290.00	939,696,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,760,841,020.04	1,824,226,121.57	63,385,101.53

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	5,467.47
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,795.20
应收债券利息	13,396,817.27
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	768.00
合计	13,404,847.94

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	1,416,000.00
合计	1,416,000.00

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	1,804,314.17
银行间市场应付交易费用	5,150.00
合计	1,809,464.17

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	1,000,000.00
应付赎回费	-
其他应付款	-
预提费用	278,469.10
合计	1,278,469.10

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	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00

注：根据《通乾证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金发起人认购的基金份额，自基金成立之日起一年内不得转让。一年以后，在本基金存续期间，发起人持有的基金份额不得低于基金份额总份额的 0.5%，即 1000 万份基金份额。

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	1,229,725,541.61	128,410,388.22	1,358,135,929.83
本期利润	-328,237,007.64	-65,025,286.69	-393,262,294.33
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-1,107,999,998.42	-	-1,107,999,998.42
本期末	-206,511,464.45	63,385,101.53	-143,126,362.92

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	1,005,847.76
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	74,465.00
其他	15,915.24
合计	1,096,228.00

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	4,063,983,930.74
减：卖出股票成本总额	4,396,019,728.88
买卖股票差价收入	-332,035,798.14

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交	1,382,279,473.86

总额	
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,342,298,405.80
减：应收利息总额	25,283,280.66
买卖债券差价收入	14,697,787.40

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资产生的收益/损失。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具投资产生的收益/损失。

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	5,180,008.69
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,180,008.69

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	-65,025,286.69
——股票投资	-45,129,569.69
——债券投资	-19,895,717.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-65,025,286.69

6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

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	11,228,231.02

银行间市场交易费用	8,125.00
合计	11,236,356.02

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
分红手续费	1,584,000.00
公告费	198,907.80
其他费用	2,100.00
上市费	29,835.26
银行费用	9,460.47
债券托管户维护费	18,000.00
合计	1,892,029.57

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

2016年6月8日至2016年7月6日期间，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议了《关于通乾证券投资基金转型有关事项的议案》。本次基金份额持有人大会于2016年7月7日表决通过了《关于通乾证券投资基金转型有关事项的议案》，本次持有人大会决议报中国证监会备案，并自该日起生效。基金管理人向上海证券交易所申请基金终止上市，并已获得上海证券交易所同意（上海证券交易所自律监管决定书[2016]193号文），本基金终止上市日为2016年8月12日。自本基金终止上市之日起，由《通乾证券投资基金基金合同》修订而成的《融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》正式生效。本基金正式转型为开放式基金，存续期限调整为不定期，基金投资目标、范围和策略予以调整，同时更名为“融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金”，基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利义务关系以《融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》为准。

除上述事项外，截至本财务报表批准日，本基金无其他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、基金发起人
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人

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

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股票交易。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的交易佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	18,770,932.26	24,942,164.78
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,159,564.72	4,157,027.47

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均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自有资金投资本基金的情况

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1月1日至2015年6月30日
基金合同生效日(2001年8月29日)持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	15,976,001.00	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	25,976,001.00	10,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.3000%	0.5000%

注：基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按交易所公布的公允的基金交易费率计算并支付。

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

关联方名称	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015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
陕国投	2,500,000.00	0.1250%	2,500,000.00	0.1250%
奇睿天使	2,500,000.00	0.1250%	2,500,000.00	0.1250%

注：除基金管理人外的其他关联方投资本基金基金份额的交易费用按交易所公布的公允的基金交易费率计算并支付。

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1月1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
中国建设银行	19,685,364.82	1,005,847.76	251,220,120.95	349,017.73

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。

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。

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

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		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	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2016年4月22日	2016年4月25日		5.5400	1,107,999,998.42	-	-1,107,999,998.42	
合计	-	-		5.5400	1,107,999,998.42	-	-1,107,999,998.42	

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601966	玲珑轮胎	2016年6月24日	2016年7月6日	新股流通受限	12.98	12.98	15,341	199,126.18	199,126.18	-
603016	新宏泰	2016年6月23日	2016年7月1日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016年6月30日	2016年7月8日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016年6月29日	2016年7月	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

		日	7日							
--	--	---	----	--	--	--	--	--	--	--

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

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
002686	亿利达	2016年4月20日	重大事项停牌	13.54	2016年7月14日	14.89	600,000	8,720,564.96	8,124,000.00	-
002246	北化股份	2015年11月23日	重大资产重组	14.10	2016年8月1日	12.69	492,934	5,706,231.17	6,950,369.40	-
601611	中国核建	2016年6月30日	交易异常波动停牌	20.92	2016年7月1日	23.01	32,269	111,973.43	675,067.48	-

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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基

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

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 中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券投资 (2015 年 12 月 31 日：同)。

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。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的可回购交易的债券资产的公允价值。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理小组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。

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、存出保证金及债券投资等。

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	19,685,364.82	-	-	-	19,685,364.82
结算备付金	3,989,253.60	-	-	-	3,989,253.60
存出保证金	1,706,507.10	-	-	-	1,706,507.10
交易性金融资产	760,923,000.00	52,437,000.00	126,336,000.00	884,530,121.57	1,824,226,121.57
应收利息	-	-	-	13,404,847.94	13,404,847.94
待摊费用	-	-	-	1,416,000.00	1,416,000.00
资产总计	786,304,125.52	52,437,000.00	126,336,000.00	899,350,969.51	1,864,428,095.03
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	2,259,298.93	2,259,298.93
应付托管费	-	-	-	376,549.81	376,549.81
应付交易费用	-	-	-	1,809,464.17	1,809,464.17
其他负债	-	-	-	3,109,145.04	3,109,145.04
负债总计	-	-	-	7,554,457.95	7,554,457.95
利率敏感度缺口	786,304,125.52	52,437,000.00	126,336,000.00	891,796,511.56	1,856,873,637.08
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	24,850,054.99	-	-	-	24,850,054.99
结算备付金	7,085,742.47	-	-	-	7,085,742.47
存出保证金	1,915,772.30	-	-	-	1,915,772.30
交易性金融资产	751,511,000.00	104,706,000.00	127,132,000.00	2,293,004,813.55	3,276,353,813.55
应收证券清算款	-	-	-	42,319,235.56	42,319,235.56
应收利息	-	-	-	23,399,535.54	23,399,535.54
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	785,362,569.76	104,706,000.00	127,132,000.00	2,358,723,584.65	3,375,924,154.41
负债					
应付证券清算款	-	-	-	5,386,800.54	5,386,800.54
应付管理人报酬	-	-	-	4,255,793.38	4,255,793.38
应付托管费	-	-	-	709,298.88	709,298.88
应付交易费用	-	-	-	4,507,655.84	4,507,655.84
其他负债	-	-	-	2,928,675.94	2,928,675.94
负债总计	-	-	-	17,788,224.58	17,788,224.58
利率敏感度缺口	785,362,569.76	104,706,000.00	127,132,000.00	2,340,935,360.07	3,358,135,929.83

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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	本期末(2016 年 6 月 30 日)	上年度末(2015 年 12 月 31 日)
市场利率下降 25 个基点	2, 807, 343. 02	3, 140, 823. 25
市场利率上升 25 个基点	-2, 766, 245. 10	-3, 085, 354. 13

6. 4. 13. 4. 2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6. 4. 13. 4. 3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的 80%，本基金投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的 20%。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	884, 530, 121. 57	47. 64	2, 293, 004, 813. 55	68. 28
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	884,530,121.57	47.64	2,293,004,813.55	68.28

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	55,734,062.22	38,099,272.96
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-55,734,062.22	-38,099,272.96

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	884,530,121.57	47.44
	其中：股票	884,530,121.57	47.44
2	固定收益投资	939,696,000.00	50.40
	其中：债券	939,696,000.00	50.40
	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	23,674,618.42	1.27
7	其他各项资产	16,527,355.04	0.89
8	合计	1,864,428,095.03	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	650,941,135.86	35.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	675,067.48	0.04
F	批发和零售业	232,823,299.73	12.54
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	70,492.40	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00
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	-	-
	合计	884,530,121.57	47.64

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	601933	永辉超市	36,157,524	149,330,574.12	8.04
2	000858	五粮液	4,538,591	147,640,365.23	7.95
3	300145	中金环境	5,600,692	122,543,140.96	6.60
4	000860	顺鑫农业	5,108,283	121,474,969.74	6.54
5	600085	同仁堂	1,990,246	59,289,428.34	3.19
6	000028	国药一致	738,139	48,052,848.90	2.59
7	600809	山西汾酒	2,151,797	47,726,857.46	2.57
8	000568	泸州老窖	1,585,203	47,080,529.10	2.54
9	000729	燕京啤酒	6,162,839	46,775,948.01	2.52

10	000759	中百集团	5,128,781	35,439,876.71	1.91
11	600111	北方稀土	2,591,837	34,497,350.47	1.86
12	002686	亿利达	600,000	8,124,000.00	0.44
13	300119	瑞普生物	500,000	8,025,000.00	0.43
14	002246	北化股份	492,934	6,950,369.40	0.37
15	601611	中国核建	32,269	675,067.48	0.04
16	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.01
17	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.01
18	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.01
19	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
20	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
21	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
22	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
23	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
24	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
25	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
26	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
27	002805	丰元股份	971	5,631.80	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	000860	顺鑫农业	253,389,224.27	7.55
2	000858	五粮液	204,715,372.32	6.10
3	601933	永辉超市	174,819,468.78	5.21
4	600030	中信证券	157,919,081.10	4.70
5	600547	山东黄金	128,657,352.00	3.83
6	600111	北方稀土	120,626,214.98	3.59
7	601668	中国建筑	118,673,182.98	3.53
8	600048	保利地产	103,763,871.95	3.09
9	000568	泸州老窖	102,558,934.40	3.05
10	600036	招商银行	90,769,055.27	2.70
11	601318	中国平安	89,440,349.75	2.66
12	002008	大族激光	89,195,012.92	2.66
13	000792	盐湖股份	86,455,734.42	2.57

14	600362	江西铜业	85,029,861.25	2.53
15	300145	中金环境	77,090,101.42	2.30
16	300203	聚光科技	69,976,264.66	2.08
17	300142	沃森生物	65,792,592.50	1.96
18	601021	春秋航空	65,100,383.66	1.94
19	600221	海南航空	63,681,313.24	1.90
20	000758	中色股份	57,899,294.35	1.72

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	002299	圣农发展	148,090,194.99	4.41
2	000860	顺鑫农业	146,403,367.71	4.36
3	600030	中信证券	138,555,886.68	4.13
4	600547	山东黄金	130,182,442.04	3.88
5	002126	银轮股份	111,453,987.40	3.32
6	601668	中国建筑	111,012,673.62	3.31
7	600305	恒顺醋业	103,861,030.82	3.09
8	600362	江西铜业	95,874,256.41	2.85
9	600048	保利地产	93,663,637.13	2.79
10	000028	国药一致	92,503,817.63	2.75
11	600587	新华医疗	91,736,326.45	2.73
12	600036	招商银行	88,278,420.94	2.63
13	601318	中国平安	87,886,591.80	2.62
14	000792	盐湖股份	87,048,569.64	2.59
15	600111	北方稀土	83,088,255.17	2.47
16	000858	五粮液	81,302,530.27	2.42
17	600756	浪潮软件	80,335,840.56	2.39
18	002008	大族激光	76,688,882.65	2.28
19	002234	民和股份	73,329,328.46	2.18
20	002224	三力士	71,267,974.54	2.12
21	600990	四创电子	69,553,116.29	2.07
22	000040	东旭蓝天	69,123,326.68	2.06
23	002746	仙坛股份	68,384,337.06	2.04

注：“卖出金额”是指卖出股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,032,674,606.59
卖出股票收入（成交）总额	4,063,983,930.74

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占期初基金资产净值比例（%）
1	国家债券	49,995,000.00	2.69
2	央行票据	-	-
3	金融债券	889,701,000.00	47.91
	其中：政策性金融债	889,701,000.00	47.91
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	939,696,000.00	50.61

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	160209	16 国开 09	3,400,000	339,422,000.00	18.28
2	140201	14 国开 01	1,000,000	101,620,000.00	5.47
3	150419	15 农发 19	1,000,000	100,020,000.00	5.39
4	160204	16 国开 04	1,000,000	99,880,000.00	5.38
5	160401	16 农发 01	700,000	69,986,000.00	3.77

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,706,507.10
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,404,847.94
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	1,416,000.00
8	其他	-
9	合计	16,527,355.04

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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
25,699	77,827.07	1,224,028,634.00	61.20%	775,971,366.00	38.80%

8.2 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	泰康人寿保险股份有限公司—分红—个人分红—019L—FH002 沪	177,122,736.00	8.86%
2	中国财产再保险有限责任公司	120,917,385.00	6.05%
3	泰康人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品—019L—CT001 沪	81,092,020.00	4.05%
4	农银人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	67,773,219.00	3.39%
5	中国人寿资产管理有限公司	63,291,378.00	3.16%
6	中国人寿保险股份有限公司	61,292,573.00	3.06%
7	泰康人寿保险股份有限公司—万能—一个险万能	52,088,738.00	2.60%
8	建信人寿保险有限公司—普通	46,655,699.00	2.33%
9	中国人寿保险股份有限公司	42,092,554.00	2.10%
10	伦敦市投资管理有限公司—客户资金	34,138,241.00	1.71%

§ 9 重大事件揭示

9.1 基金份额持有人大会决议

2016 年 6 月 8 日至 2016 年 7 月 6 日期间，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议了《关于通乾证券投资基金转型有关事项的议案》。本次基金份额持有人大会于 2016 年 7 月 7 日表决通过了《关于通乾证券投资基金转型有关事项的议案》，本次持有人大会决议报中国证监会备案，并自该日起生效。基金管理人向上海证券交易所申请基金终止上市，并已获得上海证券

交易所同意（上海证券交易所自律监管决定书[2016]193 号文），本基金终止上市日为 2016 年 8 月 12 日。自本基金终止上市之日起，由《通乾证券投资基金基金合同》修订而成的《融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》正式生效。本基金正式转型为开放式基金，存续期限调整为不定期，基金投资目标、范围和策略予以调整，同时更名为“融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金”，基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利义务关系以《融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》为准。

9.2 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

9.2.1 基金管理人重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变更。

9.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变更。

9.3 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。

9.4 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。

9.5 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 日起为本基金提供审计服务至今。

9.6 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。

9.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

9.7.1 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	
申万宏源	1	1,823,602,632.26	25.70%	1,698,313.32	25.99%	-
国泰君安	2	1,793,026,851.05	25.27%	1,645,443.80	25.18%	-

中金公司	1	1,082,275,096.58	15.25%	986,284.02	15.09%	-
国信证券	2	1,051,196,241.03	14.82%	964,777.71	14.76%	-
银河证券	1	631,204,514.76	8.90%	575,225.85	8.80%	-
中银国际	1	452,936,350.10	6.38%	421,822.68	6.46%	-
海通证券	1	246,867,772.57	3.48%	229,910.99	3.52%	-
中信证券	1	13,844,211.80	0.20%	12,892.81	0.20%	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	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，本基金无交易单元变更。

9.7.2 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
申万宏源	174,417,866.00	100.00%	2,238,600,000.00	67.36%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	581,600,000.00	17.50%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	503,200,000.00	15.14%	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

9.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	通乾证券投资基金基金分红公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、管理人网站	2016-4-19
2	通乾证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、管理人网站	2016-5-14
3	关于以通讯方式召开通乾证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、管理人网站	2016-6-2
4	关于以通讯方式召开通乾证券投资基金基金份额持有人大会第一次提示性的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、管理人网站	2016-6-3
5	关于以通讯方式召开通乾证券投资基金基金份额持有人大会第二次提示性的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、管理人网站	2016-6-6
6	通乾证券投资基金停牌提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、管理人网站	2016-6-7

§ 10 影响投资者决策的其他重要信息

2016 年 6 月 8 日至 2016 年 7 月 6 日期间，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，

审议了《关于通乾证券投资基金转型有关事项的议案》。本次基金份额持有人大会于 2016 年 7 月 7 日表决通过了《关于通乾证券投资基金转型有关事项的议案》，本次持有人大会决议报中国证监会备案，并自该日起生效。基金管理人向上海证券交易所申请基金终止上市，并已获得上海证券交易所同意（上海证券交易所自律监管决定书[2016]193 号文），本基金终止上市日为 2016 年 8 月 12 日。自本基金终止上市之日起，由《通乾证券投资基金基金合同》修订而成的《融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》正式生效。本基金正式转型为开放式基金，存续期限调整为不定期，基金投资目标、范围和策略予以调整，同时更名为“融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金”，基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利义务关系以《融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》为准。

§ 11 备查文件目录

- （一）《关于通乾证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》
- （二）中国证监会批准通乾证券投资基金设立的文件
- （三）《通乾证券投资基金基金合同》
- （四）《通乾证券投资基金托管协议》
- （五）《通乾证券投资基金招募说明书》
- （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。