

融通创业板指数增强型证券投资基金 2016 年年度报告摘要

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据融通创业板指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同规定，于 2017 年 3 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本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 2016 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	融通创业板指数
基金主代码	161613
前端交易代码	161613
后端交易代码	161663
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 4 月 6 日
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	480,862,145.74 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在基金合同规定的范围内，通过严格的投资纪
------	-------------------------

	律约束和数量化风险管理手段，结合增强收益的主动投资，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度控制在 0.5%以内、年化跟踪误差控制在 7.75%以内、基金总体投资业绩超越创业板指数的表现。
投资策略	本基金为增强型指数基金，对指数投资部分，采用完全复制指数的投资策略，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。本基金对主动投资部分采取积极配置策略，力争在跟踪误差控制范围内，获取超越基准的业绩表现。
业绩比较基准	创业板指数收益率×95% + 银行活期存款利率×5%。
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，属于高风险高收益的基金品种，其收益和风险均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		融通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	涂卫东	郭明
	联系电话	(0755) 26948666	(010) 66105799
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-883-8088、(0755) 26948088	95588
传真		(0755) 26935005	(010) 66105798

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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-23,685,838.77	47,543,862.99	31,138,759.05
本期利润	-101,248,938.56	66,511,599.14	13,509,896.28
加权平均基金份额本期利润	-0.2594	0.4456	0.1546
本期基金份额净值增长率	-25.93%	70.26%	7.80%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0378	0.0772	0.1694
期末基金资产净值	465,599,367.45	359,359,019.90	105,364,208.46
期末基金份额净值	0.968	1.377	1.169

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

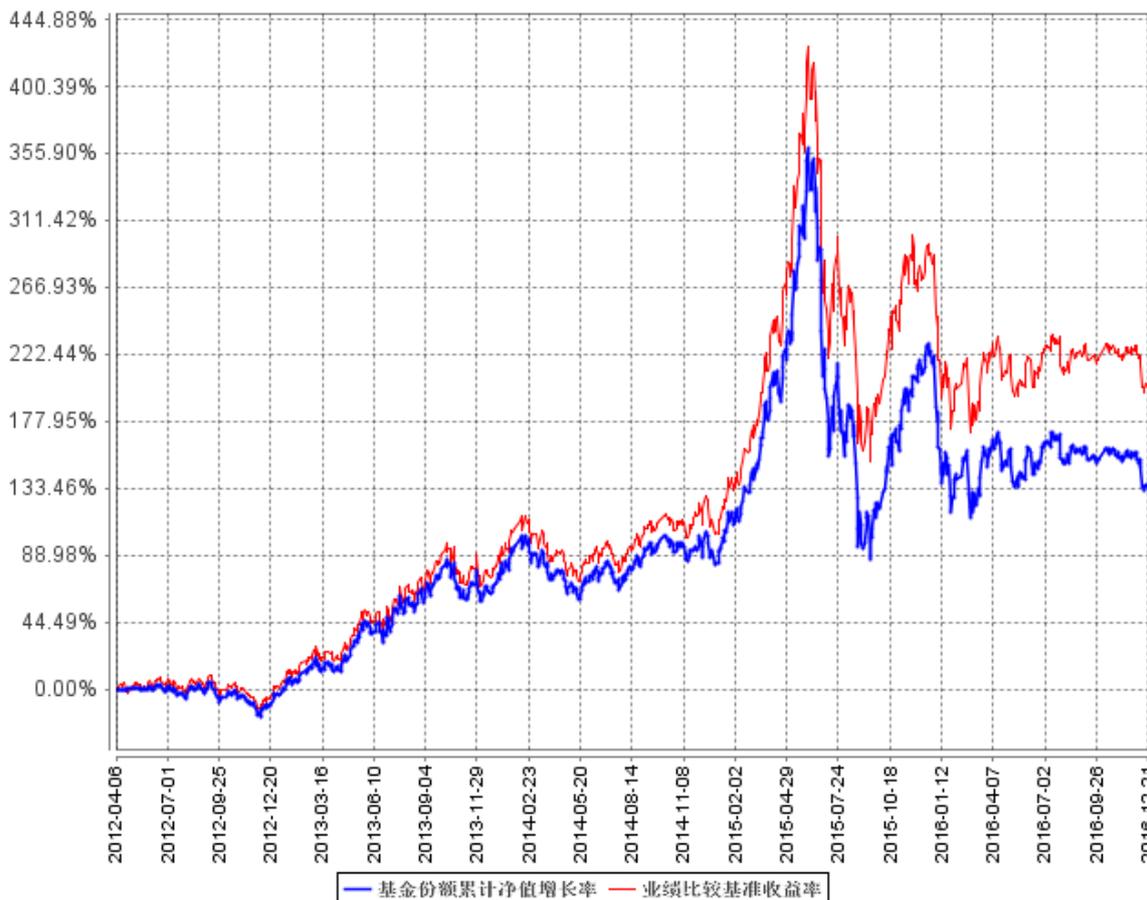
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-8.25%	1.03%	-6.82%	1.02%	-1.43%	0.01%
过去六个月	-11.76%	1.08%	-8.43%	1.07%	-3.33%	0.01%
过去一年	-25.93%	2.17%	-21.44%	2.03%	-4.49%	0.14%
过去三年	35.94%	2.41%	63.98%	2.28%	-28.04%	0.13%

自基金合同 生效起至今	132.10%	2.17%	198.19%	2.09%	-66.09%	0.08%
----------------	---------	-------	---------	-------	---------	-------

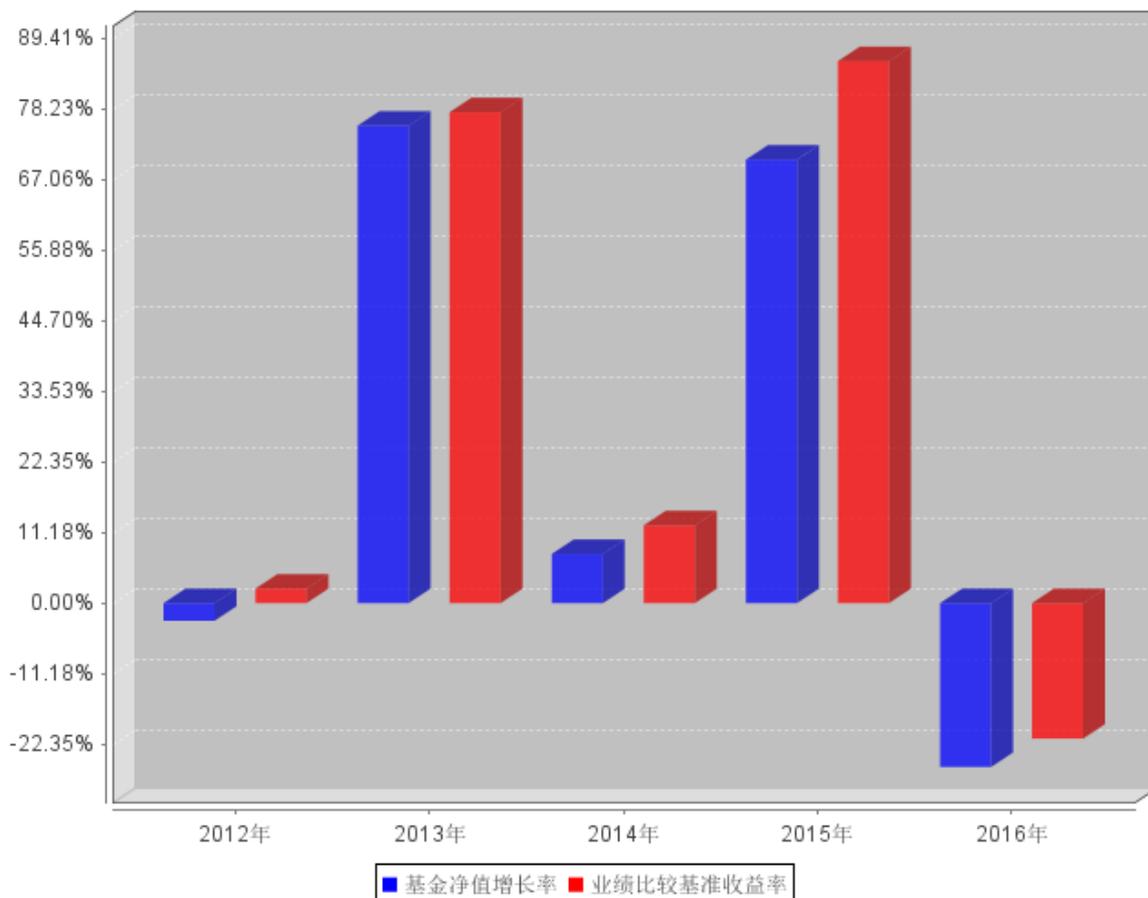
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



3.2.3 自基金合同生效以来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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同生效日为 2012 年 4 月 6 日，合同生效当年按实际存续期计算，未按整个自然年度进行折算。

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
2016	0.5000	11,283,025.59	6,212,964.66	17,495,990.25	
2015	6.0000	1,389,543,717.08	88,602,383.93	1,478,146,101.01	
2014	4.6000	1,006,741,776.42	12,605,536.79	1,019,347,313.21	
合计	11.1000	2,407,568,519.09	107,420,885.38	2,514,989,404.47	

§ 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 12 月 31 日，公司共管理六十二只开放式基金：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、融通可转债债券基金、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、融通中证大农业指数基金（LOF）、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、融通新消费混合基金、融通增丰债券基金、融通通安债券基金、融通通优债券基金、融通通乾研究精选混合基金、融通新趋势混合基金、融通通景混合基金、融通国企改革新机遇混合基金、融通通尚混合基金、融通新优选混合基金、融通通裕债券基金、融通通和债券基金、融通沪港深智慧生活混合基金、融通现金宝货币市场基金、融通通祺债券基金、融通稳利债券基金、融通通宸债券基金、融通通玺债券基金和融通通穗债券基金。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		
李勇	本基金的基金经理	2012 年 4 月 6 日	-	11	李勇先生，厦门大学经济学硕士、安徽大学数学学士，11 年证券投资从业经历，具有基金从业资格。2005 年 1 月入职融

					通基金管理有限公司，历任金融工程研究员、基金经理助理职务。现任融通深证成份指数、融通创业板指数、融通巨潮 100 指数 (LOF) 基金的基金经理。
蔡志伟	本基金的基金经理	2016 年 11 月 19 日	-	5	蔡志伟先生，华南师范大学计算机硕士、广州大学计算机学士，金融风险管理师 (FRM)，5 年证券投资从业经历，具有基金从业资格。曾就职于汇丰软件开发广东有限公司任高级软件工程师 (SSE)。2011 年 6 月加入融通基金管理有限公司，历任风险管理专员、金融工程研究员，现任融通巨潮 100 指数 (LOF)、融通深证成份指数、融通创业板指数基金的基金经理。

注：1、任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写；证券从业年限以从事证券业务相关工作的时间为计算标准。

2、2017 年 1 月 7 日起，李勇不再担任本基金的基金经理，蔡志伟先生继续担任本基金的基金经理。具体内容请参阅 2017 年 1 月 7 日在《上海证券报》和公司网站。

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

本基金在基金合同规定的范围内，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，结合增强收益的主动投资，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度控制在 0.5% 以内、年化跟踪误差控制在 7.75% 以内、基金总体投资业绩超越创业板指数的表现。

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-25.93%，同期业绩比较基准收益率为-21.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前国内经济延续平稳态势，通胀或逐步温和回升，在经济企稳背景下资金将“脱虚向实”，同时监管层加大了去杠杆和严监管的力度，金融市场资金供给将受到挤压。在此背景下，我们看到政策在稳增长和改革转型方面正有序的不断推进，供给侧改革、PPP 项目持续推进；同时，创新仍是拉动经济增长的重要推动力之一，新兴产业仍是未来中国经济的主要发展方向和新的增长点。另一方面，海外风险因素仍持续存在，美国新一届政府的政策以及美联储的加息行为也存在较大的不确定性和反复。此外，欧洲的不稳定因素的影响将持续存在和发酵。综合来看，当前国内经济、政策因素正逐渐趋于平稳，而美联储加息等海外风险因素将加大干扰，且同时考虑到全球经济面临的困境以及中国经济本身的下行压力，要警惕中长期里宽松政策带来的通胀风险。

总体来看，市场会随着海外风险因素预期变化、国内经济下行压力和稳增长政策力度的变化出现反复，在货币宽松方向不出现根本改变的局面下，市场仍将能维持振荡向上的格局，但随着去杠杆和监管趋严，市场资金面和情绪面都将受到抑制，尤其是题材炒作等投机行为将受到严厉监管，投资将更加回归基本面。市场仍将存在结构性行情：随着供给侧改革以及稳增长政策推进，传统周期板块如基建和 PPP 相关等产业将受益；其次，中长期的潜在的通胀风险也将提升传统消费板块和资源品的投资价值；此外，创新和新兴成长的步伐没有停止，随着政策支持、商业模式创新以及业绩推动的进度，新能源、云计算、虚拟现实、人工智能、以及军工电子等都存在阶段性的结构性机会。

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

本基金于 2016 年 3 月 8 日实施 2016 第 1 次利润分配，以 2016 年 2 月 24 日的可分配收益为基准，每 10 份基金份额派发现金红利 0.50 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

本报告期内，本基金托管人在对融通创业板指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，融通创业板指数增强型证券投资基金的管理人——融通管理有限公司在融通创业板指数增强型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基

金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，融通创业板指数增强型证券投资基金对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为 17,495,990.25 元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对融通基金管理有限公司编制和披露的融通创业板指数增强型证券投资基金 2016 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

本基金 2016 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(2017)第 21196 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：融通创业板指数增强型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	26,752,143.35	26,964,252.99
结算备付金	1,273,718.98	55,749.52
存出保证金	60,513.68	97,485.26
交易性金融资产	437,643,217.59	336,585,543.95
其中：股票投资	437,643,217.59	336,585,543.95
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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	6,536.99	5,538.40
应收股利	-	-
应收申购款	3,084,146.28	12,633,964.54
递延所得税资产	-	-
其他资产	54,290.28	54,290.28
资产总计	468,874,567.15	376,396,824.94
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2016年12月31日	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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	7,683,717.43
应付赎回款	2,259,698.54	8,387,584.60
应付管理人报酬	394,072.83	408,151.89
应付托管费	78,814.57	81,630.39
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	489,420.73	401,184.53
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	53,193.03	75,536.20
负债合计	3,275,199.70	17,037,805.04
所有者权益:		

实收基金	480,862,145.74	260,918,886.49
未分配利润	-15,262,778.29	98,440,133.41
所有者权益合计	465,599,367.45	359,359,019.90
负债和所有者权益总计	468,874,567.15	376,396,824.94

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.968 元，基金份额总额 480,862,145.74 份。

7.2 利润表

会计主体：融通创业板指数增强型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

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 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	-93,137,388.93	71,158,915.13
1. 利息收入	280,197.43	1,320,787.86
其中：存款利息收入	280,197.43	1,320,787.86
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	-16,982,530.41	45,213,343.62
其中：股票投资收益	-18,228,212.70	44,805,070.38
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
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	1,245,682.29	408,273.24
3. 公允价值变动收益	-77,563,099.79	18,967,736.15

4. 汇兑收益	-	-
5. 其他收入	1, 128, 043. 84	5, 657, 047. 50
减：二、费用	8, 111, 549. 63	4, 647, 315. 99
1. 管理人报酬	4, 104, 561. 14	2, 627, 745. 63
2. 托管费	820, 912. 25	525, 549. 14
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2, 922, 686. 24	1, 330, 638. 22
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	263, 390. 00	163, 383. 00
三、利润总额	-101, 248, 938. 56	66, 511, 599. 14
减：所得税费用	-	-
四、净利润	-101, 248, 938. 56	66, 511, 599. 14

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通创业板指数增强型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	260, 918, 886. 49	98, 440, 133. 41	359, 359, 019. 90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-101, 248, 938. 56	-101, 248, 938. 56
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	219, 943, 259. 25	5, 042, 017. 11	224, 985, 276. 36
其中：1. 基金申购款	1, 075, 992, 890. 46	58, 247, 268. 60	1, 134, 240, 159. 06
2. 基金赎回款	-856, 049, 631. 21	-53, 205, 251. 49	-909, 254, 882. 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	-	-17,495,990.25	-17,495,990.25
五、期末所有者权益（基金净值）	480,862,145.74	-15,262,778.29	465,599,367.45
项目	上年度可比期间		
	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）	90,099,515.45	15,264,693.01	105,364,208.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	66,511,599.14	66,511,599.14
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	170,819,371.04	1,494,809,942.27	1,665,629,313.31
其中：1. 基金申购款	3,284,395,519.00	2,927,442,313.30	6,211,837,832.30
2. 基金赎回款	-3,113,576,147.96	-1,432,632,371.03	-4,546,208,518.99
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-1,478,146,101.01	-1,478,146,101.01
五、期末所有者权益（基金净值）	260,918,886.49	98,440,133.41	359,359,019.90

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：

高峰

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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.1.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.2 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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
新时代证券股份有限公司（“新时代证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
日兴资产管理有限公司	基金管理人的股东
深圳市融通资本管理股份有限公司(原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。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.3.1.1 股票交易

本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.3.1.2 权证交易

本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.3.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元发生交易。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 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 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,104,561.14	2,627,745.63
其中：支付销售机构的客户维护费	2,357,178.07	826,806.88

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 1.00% 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 × 1.00% / 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。

7.4.3.2.2 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 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	820,912.25	525,549.14

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 × 0.20% / 当年天数。

7.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.1 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。

7.4.3.4.2 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。

7.4.3.5 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12月31日		2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	26,752,143.35	190,836.11	26,964,252.99	336,781.88

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金本期及上年度可比期间未买入管理人、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、本基金本期及上年度可比期间未买入管理人、托管人的主要股东（非控股）在承销期内承销的证券。

7.4.3.7 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项的说明。

7.4.4 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1 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

7.4.12.1.1 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
300583	赛托生物	16/12/29	17/01/06	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-

300587	天铁股份	16/12/28	17/01/05	新股流通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	16/12/29	17/01/10	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	16/12/28	17/01/06	新股流通受限	15.28	15.28	682	10,420.96	10,420.96	-
300586	美联新材	16/12/26	17/01/04	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	16/12/30	17/01/10	新股流通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	16/12/27	17/01/05	新股流通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

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。

7.4.4.2 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
300104	乐视网	16/12/07	重大资产重组	35.80	17/01/16	36.88	327,067	14,097,513.98	11,708,998.60	-
300496	中科创达	16/10/11	重大资产重组	52.28	17/01/06	47.49	81,923	4,856,084.19	4,282,934.44	-
300212	易华录	16/11/30	重大资产重组	34.00	-	-	98,161	3,421,585.98	3,337,474.00	-
300367	东方网力	16/12/15	重大资产重组	20.04	-	-	160,937	4,145,765.07	3,225,177.48	-

300271	华宇软件	16/12/19	重大资产重组	17.45	-	-	182,596	3,693,076.18	3,186,300.20	-
300088	长信科技	16/09/12	重大资产重组	14.66	-	-	116,524	1,743,029.79	1,708,241.84	-
300098	高新兴	16/11/17	重大资产重组	14.03	17/01/23	14.26	24,100	350,136.84	338,123.00	-

注：本基金截至 2016 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。

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.4.3.1 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。

7.4.4.3.2 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	437,643,217.59	93.34
	其中：股票	437,643,217.59	93.34
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	28,025,862.33	5.98

7	其他各项资产	3,205,487.23	0.68
8	合计	468,874,567.15	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资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	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	5,314,204.92	1.14
B	采矿业	-	-
C	制造业	206,748,925.44	44.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,070,985.92	1.09
F	批发和零售业	2,365,440.00	0.51
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	154,500,285.42	33.18
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	8,002,796.34	1.72
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	11,856,432.24	2.55
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	12,537,759.02	2.69
R	文化、体育和娱乐业	29,392,701.39	6.31
S	综合	-	-
	合计	435,789,530.69	93.60

8.2.2 期末积极投资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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	511,917.54	0.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,341,769.36	0.29
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	-	-
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	1,853,686.90	0.40

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

8.3.1 期末指数投资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	300059	东方财富	940,017	15,914,487.81	3.42
2	300070	碧水源	676,737	11,856,432.24	2.55
3	300072	三聚环保	254,278	11,770,528.62	2.53
4	300104	乐视网	327,067	11,708,998.60	2.51
5	300017	网宿科技	217,672	11,669,395.92	2.51
6	300024	机器人	492,979	10,539,891.02	2.26
7	300124	汇川技术	448,430	9,116,581.90	1.96
8	300136	信维通信	300,380	8,560,830.00	1.84
9	300027	华谊兄弟	717,285	7,890,135.00	1.69
10	300408	三环集团	474,871	7,540,951.48	1.62

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	300300	汉鼎宇佑	51,752	1,084,721.92	0.23
2	300295	三六五网	8,550	247,009.50	0.05
3	002831	裕同科技	2,219	153,554.80	0.03
4	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.02
5	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.01

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	300059	东方财富	24,545,837.97	6.83
2	300336	新文化	21,539,526.48	5.99
3	300072	三聚环保	21,264,863.81	5.92
4	300136	信维通信	20,390,981.56	5.67
5	300134	大富科技	19,158,111.36	5.33
6	300017	网宿科技	19,147,813.29	5.33
7	300070	碧水源	17,946,035.28	4.99
8	300295	三六五网	17,643,177.88	4.91
9	300431	暴风集团	16,892,452.26	4.70
10	300011	鼎汉技术	16,320,220.70	4.54
11	300408	三环集团	15,985,688.83	4.45
12	300024	机器人	15,194,746.28	4.23
13	300207	欣旺达	15,174,511.20	4.22
14	300159	新研股份	14,866,736.22	4.14
15	300203	聚光科技	14,146,728.39	3.94
16	300228	富瑞特装	13,971,947.72	3.89
17	300257	开山股份	13,833,145.67	3.85
18	300090	盛运环保	13,763,215.52	3.83
19	300216	千山药机	13,041,364.82	3.63
20	300113	顺网科技	12,941,270.08	3.60
21	300291	华录百纳	12,795,279.40	3.56
22	300352	北信源	12,658,777.70	3.52
23	300226	上海钢联	12,538,147.38	3.49

24	300383	光环新网	12,499,280.00	3.48
25	300133	华策影视	12,496,831.69	3.48
26	300418	昆仑万维	12,350,358.26	3.44
27	300266	兴源环境	12,132,494.90	3.38
28	300124	汇川技术	12,076,010.34	3.36
29	300364	中文在线	11,978,444.76	3.33
30	300115	长盈精密	11,917,611.88	3.32
31	300212	易华录	11,875,215.22	3.30
32	300433	蓝思科技	11,729,356.50	3.26
33	300122	智飞生物	11,620,648.72	3.23
34	300033	同花顺	11,453,549.30	3.19
35	300020	银江股份	11,337,026.02	3.15
36	300315	掌趣科技	11,268,107.44	3.14
37	300058	蓝色光标	11,264,245.41	3.13
38	300202	聚龙股份	11,236,551.90	3.13
39	300052	中青宝	11,214,301.51	3.12
40	300156	神雾环保	11,189,105.34	3.11
41	300251	光线传媒	10,778,461.00	3.00
42	300079	数码视讯	10,590,114.69	2.95
43	300002	神州泰岳	10,500,215.76	2.92
44	300347	泰格医药	10,301,446.69	2.87
45	300027	华谊兄弟	10,172,653.93	2.83
46	300288	朗玛信息	10,131,101.96	2.82
47	300077	国民技术	10,120,185.00	2.82
48	300088	长信科技	10,054,622.20	2.80
49	300188	美亚柏科	9,970,395.88	2.77
50	300055	万邦达	9,851,859.98	2.74
51	300168	万达信息	9,718,529.13	2.70

52	300287	飞利信	9,535,014.26	2.65
53	300078	思创医惠	9,422,696.00	2.62
54	300026	红日药业	9,342,238.69	2.60
55	300053	欧比特	9,263,027.32	2.58
56	300333	兆日科技	9,247,520.05	2.57
57	300231	银信科技	9,231,692.15	2.57
58	300014	亿纬锂能	9,206,021.84	2.56
59	300075	数字政通	9,129,179.20	2.54
60	300339	润和软件	9,121,759.08	2.54
61	300104	乐视网	9,073,904.17	2.53
62	300271	华宇软件	8,830,604.19	2.46
63	300369	绿盟科技	8,620,931.68	2.40
64	300238	冠昊生物	8,356,029.25	2.33
65	300367	东方网力	8,149,670.10	2.27
66	300359	全通教育	8,128,832.76	2.26
67	300003	乐普医疗	8,053,381.18	2.24
68	300276	三丰智能	8,036,058.00	2.24
69	300015	爱尔眼科	7,971,576.30	2.22
70	300229	拓尔思	7,965,697.57	2.22
71	300073	当升科技	7,705,452.20	2.14
72	300032	金龙机电	7,652,043.67	2.13
73	300085	银之杰	7,651,557.54	2.13
74	300096	易联众	7,593,917.60	2.11
75	300253	卫宁健康	7,488,592.29	2.08
76	300068	南都电源	7,458,255.85	2.08
77	300178	腾邦国际	7,249,213.15	2.02
78	300171	东富龙	7,244,942.05	2.02

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	300295	三六五网	18,959,982.18	5.28
2	300134	大富科技	18,267,409.01	5.08
3	300136	信维通信	17,945,943.50	4.99
4	300336	新文化	17,885,959.65	4.98
5	300059	东方财富	16,900,404.81	4.70
6	300072	三聚环保	16,460,641.08	4.58
7	300011	鼎汉技术	15,658,336.22	4.36
8	300207	欣旺达	14,477,543.69	4.03
9	300017	网宿科技	13,760,318.26	3.83
10	300228	富瑞特装	13,274,886.82	3.69
11	300104	乐视网	13,174,550.19	3.67
12	300203	聚光科技	12,834,768.56	3.57
13	300070	碧水源	12,800,599.96	3.56
14	300257	开山股份	12,760,067.94	3.55
15	300431	暴风集团	12,447,165.48	3.46
16	300088	长信科技	12,440,184.01	3.46
17	300226	上海钢联	12,422,005.94	3.46
18	300090	盛运环保	12,358,220.73	3.44
19	300352	北信源	11,823,764.05	3.29
20	300052	中青宝	11,799,965.31	3.28
21	300216	千山药机	11,787,972.58	3.28
22	300291	华录百纳	11,654,016.33	3.24
23	300288	朗玛信息	11,488,879.85	3.20
24	300159	新研股份	11,146,626.46	3.10

25	300212	易华录	10,731,804.29	2.99
26	300133	华策影视	10,658,538.08	2.97
27	300122	智飞生物	10,618,293.92	2.95
28	300024	机器人	10,543,969.79	2.93
29	300408	三环集团	10,448,031.34	2.91
30	300202	聚龙股份	10,360,274.16	2.88
31	300113	顺网科技	10,133,455.23	2.82
32	300231	银信科技	10,071,392.18	2.80
33	300020	银江股份	9,997,210.00	2.78
34	300433	蓝思科技	9,747,789.87	2.71
35	300229	拓尔思	9,535,868.02	2.65
36	300115	长盈精密	9,254,851.99	2.58
37	300156	神雾环保	9,247,668.98	2.57
38	300251	光线传媒	9,181,443.85	2.55
39	300276	三丰智能	9,177,940.14	2.55
40	300058	蓝色光标	9,153,994.04	2.55
41	300347	泰格医药	9,084,996.85	2.53
42	300171	东富龙	8,748,149.18	2.43
43	300079	数码视讯	8,721,923.99	2.43
44	300002	神州泰岳	8,560,471.59	2.38
45	300077	国民技术	8,388,531.00	2.33
46	300364	中文在线	8,375,474.00	2.33
47	300287	飞利信	8,344,601.12	2.32
48	300053	欧比特	8,102,987.50	2.25
49	300271	华宇软件	8,017,813.58	2.23
50	300252	金信诺	8,016,302.10	2.23
51	300026	红日药业	7,875,720.70	2.19
52	300033	同花顺	7,798,689.38	2.17

53	300075	数字政通	7,770,086.36	2.16
54	300266	兴源环境	7,505,336.14	2.09
55	300124	汇川技术	7,465,763.01	2.08
56	300369	绿盟科技	7,447,427.22	2.07

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	1,105,942,141.40
卖出股票收入（成交）总额	909,093,155.27

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

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

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	60,513.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,536.99
5	应收申购款	3,084,146.28
6	其他应收款	54,290.28
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,205,487.23

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

8.12.5.1 期末指数投资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	300104	乐视网	11,708,998.60	2.51	重大资产重组

8.12.5.2 期末积极投资前五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	300583	赛托生物	63,738.78	0.01	新股锁定

§ 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
46,401	10,363.18	256,454.90	0.05%	480,605,690.84	99.95%

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	606,098.06	0.1260%

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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2012 年 4 月 6 日) 基金份额总额	487,321,720.94
本报告期期初基金份额总额	260,918,886.49
本报告期基金总申购份额	1,075,992,890.46
减:本报告期基金总赎回份额	856,049,631.21

本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	480,862,145.74

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期未召开基金份额持有人大会。

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

(1) 基金管理人的重大变动

2017 年 3 月 4 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第五届董事会第十七次临时会议审议并通过，同意孟朝霞女士辞去公司总经理职务，并决定由公司董事长高峰先生代为履行公司总经理职务。

(2) 本报告期基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内无诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期未发生改变。

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 45,000.00 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

本基金本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
海通证券	1	557,773,895.05	27.70%	508,300.27	27.70%	-

长江证券	1	524,831,804.38	26.06%	478,280.44	26.06%	-
光大证券	1	257,969,081.82	12.81%	235,087.82	12.81%	-
平安证券	1	206,525,522.21	10.26%	188,206.61	10.26%	-
中信证券	2	158,557,764.49	7.87%	144,493.85	7.87%	-
安信证券	1	126,015,338.84	6.26%	114,837.92	6.26%	-
中泰证券	2	63,404,251.11	3.15%	57,780.27	3.15%	-
中金公司	1	60,645,959.74	3.01%	55,266.85	3.01%	-
长城证券	1	57,846,208.18	2.87%	52,715.31	2.87%	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
中信万通	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	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) 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、交易单元变更情况

本基金无交易单元变更。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

融通基金管理有限公司

2017年3月30日