

融通动力先锋混合型证券投资基金
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动力先锋混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)基金合同规定，于 2017 年 3 月 24 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	融通动力先锋混合
基金主代码	161609
前端交易代码	161609
后端交易代码	161659
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 11 月 15 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	661,319,309.12 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为主动式混合型基金，主要投资于制造业和服务行业中价值暂时被市场低估的股票，分享中国工业化深化过程中两大推动经济增长的引擎——“制造业（特别是装备制造业）和服务业（特别是现代服务业）”的高速成长，力争在控制风险并保持良好流动性的前提下，追求稳定的、优于业绩基准的回报，为投资者实现基金资产稳定且丰厚的长期资本增值。
投资策略	在遵守有关法律、法规和本基金合同的有关规定的的前提下，本基金采取“自上而下”与“自下而上”相结合、互相印证的投资策略，贯彻基金管理人“识别

	风险、管理风险”的投资理念
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合基金，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，但低于股票基金，属于中等预期收益和预期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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	涂卫东
	联系电话	(0755) 26948666
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com
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	-80,102,914.69	720,258,385.04	777,440,434.91
本期利润	-129,616,827.19	673,629,842.67	755,474,624.82
加权平均基金份额本期利润	-0.1635	0.7021	0.4751
本期基金份额净值增长率	-12.70%	19.42%	44.31%
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	0.7178	0.8577	0.3527
期末基金资产净值	1,135,982,504.47	1,266,245,767.70	2,717,853,279.81
期末基金份额净值	1.718	1.968	1.648

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）。

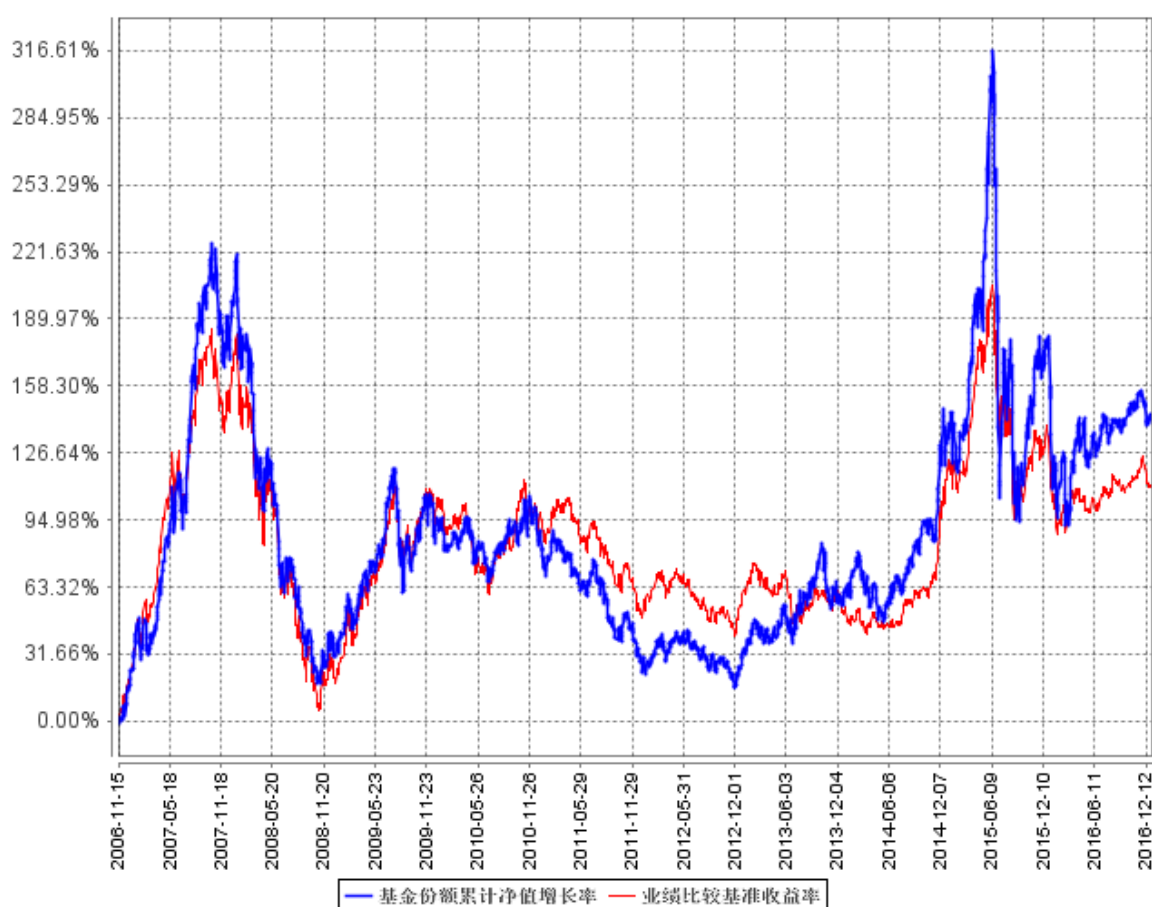
3.2 基金净值表现

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	0.76%	0.72%	0.94%	0.58%	-0.18%	0.14%
过去六个月	4.76%	0.76%	3.70%	0.61%	1.06%	0.15%
过去一年	-12.70%	1.82%	-9.08%	1.12%	-3.62%	0.70%
过去三年	50.44%	2.17%	37.38%	1.43%	13.06%	0.74%
过去五年	87.35%	1.89%	38.24%	1.30%	49.11%	0.59%
自基金合同生效起至今	144.49%	1.84%	111.47%	1.53%	33.02%	0.31%

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

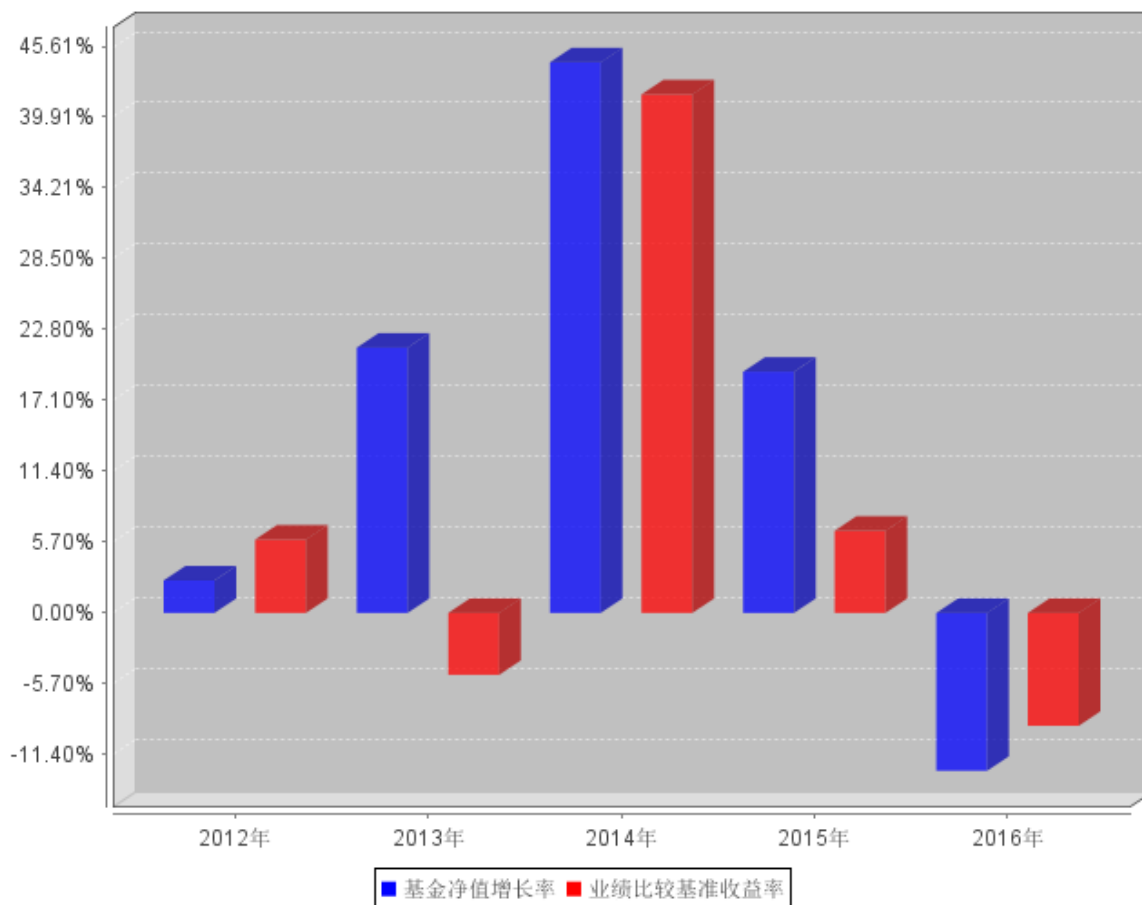
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金业绩比较基准项目分段计算，其中 2013 年 6 月 30 日之前（含此日）采用“富时中国 A600 指数收益率×80%+新华巴克莱资本中国全债指数收益率×20%”，2013 年 7 月 1 日起使用新基准即“沪深 300 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%”。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年没有实施利润分配。

§ 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		
朱丹	本基金的基金经理	2015/7/4	-	10	朱丹女士，暨南大学金融学硕士、化学学士，10 年证券投资从业经历，具有基金从业资格。历任晨星中国咨询公司数据分析师、金鹰基金行业研究员、研究总监助理、金鹰中小盘精选、金鹰红利价值、金鹰中证技术领先基金基金经理。2015 年 3 月加入融通基金管理有限公司，现任融通动力先锋混合基金的基金经理。
杨博琳	本基金的基金经理	2015/3/28	2016/7/29	6	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，6 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，现任融通新区新经济灵活配置混合基金的基金经理。

注：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。

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》及其他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。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

2016 年市场运行得非常有特点：开年快速下跌，两次熔断，个股回调幅度巨大。随后，熔断机制取消，大小非减持规范，证监会主席换人，市场趋于稳定。然后市场在怀疑中一路上涨，从 2 月底涨到了 11 月底，上证综指从 2638 点涨到 3301 点，基本可以算作一波小牛市了，11 月底市场一片乐观。12 月初，管理层对保险举牌行为进行规范；中旬，美联储加息；12 月末，债市大幅下跌，市场快速回撤到 3100 点左右。全年上证指数下跌 12.31%，创业板下跌-27.71%，沪深 300 和中小创股票的走势分化非常明显。从市场风格上看，两种类型的股票走势持续较强：一类是白酒家电等基本面好估值低的白马股，另一类是市值非常小基本没有主业利润的壳公司。其余处于中间状态的公司都最多有阶段性机会，一般上涨后回调也比较明显。

本基金 2016 年主动性的仓位变动不明显，基本是申购赎回带来的仓位变动。2016 年上半年主要投资方向仍然以成长型的公司为主，2016 年下半年开始逐渐配置一些沪深 300 的价值股。2016 年基金组合里行业变动不大，主要以制造，消费和医药行业为主。

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-12.70%，同期业绩比较基准收益率为-9.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年的宏观经济形势很难判断，现在能比较清晰的看到的是货币政策大概率收紧，而财政政策可能会定向宽松，防风险放在更加重要的位置。从目前情况看，市场中短期仍然维持窄幅震荡，上涨和下跌的空间都不大，需要等待新的刺激因素来帮助大盘选择方向。由于 12 月份市场对各类风险预期都比较充分，因此 2017 年 1 季度大概率不会再出现明显回调，可能是维持震荡。从另外一个角度看，产业资本的行为包括保险资金的行为会明显影响二级市场，增持和减持会长期并行存在，市场结构可能会出现明显分化。此外，当前中国经济正处于重要的转型阶段，制度变革及新技术应用将对是经济成功转型的重要驱动因素，必将对众多传统产业产生深远影响。我理解之前的上涨是预期的上涨，经济的基本面并没有跟上，而这一波深度回调后，市场会开始集中关注有真实业绩兑现的公司，而众多讲概念的中小股票将面临长期系统性估值的下移。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照《融通基金管理有限公司证券投资基金估值业务原则和程序》进行，公司设立由研究部、风险管理部、登记清算部、固定收益部、国际业务部和监察稽核部共同组成的估值委员会，通过参考行业协会估值意见、参考独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员不包含基金经理。

估值委员会定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经公司总经理办公会议审批后方可实施。基金在采用新投资策略或投资新品种时，应评价现有估值政策和程序的适用性。其中研究部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，金融工程小组负责估值方法的研究、价格的计算及复核，登记清算部进行具体的估值核算并计算每日基金净值，每日对基金所投资品种的公开信息、基金会计估值方法的法规等进行搜集并整理汇总，供估值委员会参考，监察稽核部负责基金估值业务的事前、事中及事后的审核工作。基金经理不参与估值决定，参与估值流程各方之间亦不存在任何重大利

益冲突，截至报告期末公司未与外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期暂不进行利润分配，符合基金合同约定。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对融通动力先锋混合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，融通动力先锋混合型证券投资基金的管理人——融通基金管理有限公司在融通动力先锋混合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，融通动力先锋混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对融通基金管理有限公司编制和披露的融通动力先锋混合型证券投资基金 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 21173 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：融通动力先锋混合型证券投资基金

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	228,236,904.84	210,636,614.01
结算备付金	12,591,162.65	4,979,907.80
存出保证金	585,259.72	1,098,580.57

交易性金融资产	985,524,787.46	1,132,870,892.27
其中：股票投资	985,524,787.46	1,132,870,892.27
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	24,922,960.61	12,286,720.12
应收利息	59,667.41	63,080.21
应收股利	-	-
应收申购款	26,794.10	215,808.36
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,251,947,536.79	1,362,151,603.34
负债和所有者权益	本期末 2016年12月31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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	88,923,189.36
应付赎回款	111,060,611.09	1,556,450.22
应付管理人报酬	1,709,646.10	1,586,245.23
应付托管费	284,941.01	264,374.23
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,892,759.49	2,723,976.97
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,017,074.63	851,599.63
负债合计	115,965,032.32	95,905,835.64
所有者权益：		
实收基金	661,319,309.12	643,557,409.28
未分配利润	474,663,195.35	622,688,358.42
所有者权益合计	1,135,982,504.47	1,266,245,767.70
负债和所有者权益总计	1,251,947,536.79	1,362,151,603.34

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.718 元，基金份额总额 661,319,309.12 份。

7.2 利润表

会计主体：融通动力先锋混合型证券投资基金

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	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	-92,527,840.62	745,613,292.98
1. 利息收入	3,621,858.53	3,509,603.34
其中：存款利息收入	1,780,060.62	1,859,074.70
债券利息收入	-	1,629,753.19
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,841,797.91	20,775.45
其他利息收入	-	-
2. 投资收益	-47,367,569.58	786,909,687.15
其中：股票投资收益	-50,011,817.44	779,390,452.41
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	335,611.93
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	2,644,247.86	7,183,622.81
3. 公允价值变动收益	-49,513,912.50	-46,628,542.37
4. 汇兑收益	-	-
5. 其他收入	731,782.93	1,822,544.86
减：二、费用	37,088,986.57	71,983,450.31
1. 管理人报酬	19,536,980.40	27,006,610.25
2. 托管费	3,256,163.33	4,501,101.61
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	13,876,564.84	39,950,584.28
5. 利息支出	-	5,064.02
其中：卖出回购金融资产支出	-	5,064.02
6. 其他费用	419,278.00	520,090.15
三、利润总额	-129,616,827.19	673,629,842.67
减：所得税费用	-	-
四、净利润	-129,616,827.19	673,629,842.67

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通动力先锋混合型证券投资基金

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)	643,557,409.28	622,688,358.42	1,266,245,767.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-129,616,827.19	-129,616,827.19
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	17,761,899.84	-18,408,335.88	-646,436.04
其中：1. 基金申购款	423,062,192.28	243,905,005.95	666,967,198.23
2. 基金赎回款	-405,300,292.44	-262,313,341.83	-667,613,634.27
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)	661,319,309.12	474,663,195.35	1,135,982,504.47
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)	1,649,056,108.88	1,068,797,170.93	2,717,853,279.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	673,629,842.67	673,629,842.67
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,005,498,699.60	-1,119,738,655.18	-2,125,237,354.78
其中：1. 基金申购款	409,631,308.49	337,802,172.59	747,433,481.08
2. 基金赎回款	-1,415,130,008.09	-1,457,540,827.77	-2,872,670,835.86
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)	643,557,409.28	622,688,358.42	1,266,245,767.70

注：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	_____ 颜锡廉	_____ 刘美丽
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	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

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
融通基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
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”)	基金管理人股东、基金销售机构
日兴资产管理有限公司	基金管理人股东
深圳市融通资本管理股份有限公司 (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。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交 总额的比例	成交金额	占当期股票成交 总额的比例
新时代证券	341,718,089.23	3.71%	3,863,810,269.11	15.02%

7.4.4.1.2 债券交易

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债券交易。

7.4.4.1.3 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.4.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
新时代证券	318,244.02	3.78%	150,055.17	7.93%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例

新时代证券	3,520,810.22	15.20%	72,663.49	2.67%
-------	--------------	--------	-----------	-------

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 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	19,536,980.40	27,006,610.25
其中：支付销售机构的客户维护费	2,549,833.44	4,312,668.68

注：1、支付基金管理人融通基金管理有限公司的基金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：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

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

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 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	3,256,163.33	4,501,101.61

注：支付基金托管人中国工商银行的基金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：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，基金管理人主要股东及其控制的机构均未持有本基金份额。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		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	228,236,904.84	1,521,786.50	210,636,614.01	1,503,853.87

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。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

7.4.5 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016-12-20	2017-1-3	新股未上市	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603228	景旺电子	2016-12-28	2017-1-6	新股未上市	23.16	23.16	3,491	80,851.56	80,851.56	-
603877	太平鸟	2016-12-29	2017-1-9	新股未上市	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016-12-29	2017-1-6	新股未上市	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603689	皖天然气	2016-12-30	2017-1-10	新股未上市	7.87	7.87	4,819	37,925.53	37,925.53	-
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-1-5	新股未上市	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龙股份	2016-12-30	2017-1-10	新股未上市	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
300587	天铁股份	2016-12-28	2017-1-5	新股未上市	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	2016-12-29	2017-1-10	新股未上市	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016-12-28	2017-1-6	新股未上市	15.28	15.28	682	10,420.96	10,420.96	-
603186	华正新材	2016-12-26	2017-1-3	新股未上市	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016-12-27	2017-1-5	新股未上市	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-

300586	美联新材	2016-12-26	2017-1-4	新股未上市	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016-12-30	2017-1-10	新股未上市	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	2016-12-27	2017-1-5	新股未上市	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。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。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单价	复牌日期	复牌 开盘单价	数量（股）	期末 成本总额	期末估值总额	备注
002509	天广中茂	2016-9-21	重大资产重组	12.53	-	-	10,000,000	79,266,012.82	125,300,000.00	-
002659	中泰桥梁	2016-11-3	重大资产重组	23.07	2017-1-6	19.60	1,849,000	41,310,623.47	42,656,430.00	-
000710	天兴仪表	2016-12-29	重大资产重组	47.41	2017-1-4	52.15	523,012	14,003,511.20	24,795,998.92	-
603986	兆易创新	2016-9-19	重大资产重组	177.97	2017-3-13	195.77	1,133	26,353.58	201,640.01	-

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。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因从事银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因从事交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	985,524,787.46	78.72
	其中：股票	985,524,787.46	78.72
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	240,828,067.49	19.24
7	其他各项资产	25,594,681.84	2.04
8	合计	1,251,947,536.79	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	735,881,496.51	64.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,925.53	0.00
E	建筑业	42,672,022.23	3.76
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	60,849,458.68	5.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,747,952.20	1.03
J	金融业	59,135,966.92	5.21
K	房地产业	25,713,204.00	2.26
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	49,486,761.39	4.36
S	综合	-	-
	合计	985,524,787.46	86.76

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	002509	天广中茂	10,000,000	125,300,000.00	11.03
2	002480	新筑股份	8,379,178	95,103,670.30	8.37
3	002341	新纶科技	4,008,255	84,534,097.95	7.44
4	300238	冠昊生物	1,843,761	61,489,429.35	5.41
5	601333	广深铁路	12,000,000	60,840,000.00	5.36
6	601336	新华保险	1,348,314	59,029,186.92	5.20
7	002068	黑猫股份	6,635,372	55,604,417.36	4.89

8	002343	慈文传媒	1,095,567	49,486,761.39	4.36
9	300093	金刚玻璃	1,899,000	46,354,590.00	4.08
10	002659	中泰桥梁	1,849,000	42,656,430.00	3.76

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	300093	金刚玻璃	134,663,294.18	10.63
2	002341	新纶科技	124,767,023.48	9.85
3	002539	新都化工	118,487,807.38	9.36
4	002480	新筑股份	112,252,214.02	8.86
5	300238	冠昊生物	96,187,521.14	7.60
6	601333	广深铁路	80,214,009.42	6.33
7	002308	威创股份	74,753,903.80	5.90
8	300338	开元仪器	73,538,861.27	5.81
9	600085	同仁堂	72,769,850.27	5.75
10	002509	天广中茂	70,046,149.16	5.53
11	600016	民生银行	68,651,337.42	5.42
12	601336	新华保险	67,407,222.97	5.32
13	300240	飞力达	65,999,014.77	5.21
14	002638	勤上光电	65,516,803.51	5.17
15	300146	汤臣倍健	65,071,376.64	5.14
16	601515	东风股份	64,912,756.25	5.13
17	000972	中基健康	61,864,142.68	4.89
18	002068	黑猫股份	61,294,908.76	4.84
19	002343	慈文传媒	60,871,687.67	4.81
20	600115	东方航空	59,616,576.62	4.71
21	600029	南方航空	59,592,516.51	4.71
22	300090	盛运环保	56,829,314.46	4.49
23	002303	美盈森	55,114,459.47	4.35
24	002123	梦网荣信	54,460,576.23	4.30
25	300282	汇冠股份	53,689,464.55	4.24
26	002584	西陇科学	52,852,326.44	4.17

27	002345	潮宏基	49,378,527.52	3.90
28	002673	西部证券	49,234,800.47	3.89
29	002390	信邦制药	49,132,366.06	3.88
30	300326	凯利泰	46,259,894.25	3.65
31	000651	格力电器	45,049,244.00	3.56
32	000587	金洲慈航	43,661,869.73	3.45
33	600598	北大荒	42,689,773.88	3.37
34	002659	中泰桥梁	41,310,623.47	3.26
35	002294	信立泰	40,915,965.43	3.23
36	300097	智云股份	40,616,767.47	3.21
37	000673	当代东方	39,670,492.44	3.13
38	002597	金禾实业	38,642,152.03	3.05
39	601988	中国银行	37,488,640.00	2.96
40	600153	建发股份	37,465,055.44	2.96
41	000710	天兴仪表	35,605,051.50	2.81
42	000818	方大化工	35,260,400.16	2.78
43	600240	华业资本	34,683,394.19	2.74
44	000568	泸州老窖	33,548,340.11	2.65
45	300409	道氏技术	33,016,984.60	2.61
46	000829	天音控股	31,359,236.46	2.48
47	300364	中文在线	31,256,825.12	2.47
48	300170	汉得信息	30,951,132.98	2.44
49	601177	杭齿前进	30,662,212.26	2.42
50	300363	博腾股份	30,540,411.14	2.41
51	300050	世纪鼎利	30,501,448.00	2.41
52	000055	方大集团	30,291,590.80	2.39
53	002044	美年健康	29,395,644.54	2.32
54	002481	双塔食品	29,325,093.51	2.32
55	600622	嘉宝集团	28,947,626.70	2.29
56	000004	国农科技	28,388,374.64	2.24
57	000026	飞亚达A	28,355,104.50	2.24
58	300159	新研股份	28,241,676.15	2.23
59	002683	宏大爆破	28,171,598.56	2.22
60	600300	维维股份	27,817,708.53	2.20
61	300242	明家联合	27,151,811.99	2.14
62	300113	顺网科技	26,224,228.98	2.07

63	002537	海立美达	26,111,203.86	2.06
64	002355	兴民智通	25,841,120.82	2.04
65	002329	皇氏集团	25,551,926.49	2.02
66	601555	东吴证券	25,547,896.64	2.02
67	002732	燕塘乳业	25,455,834.54	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。

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	002345	潮宏基	131,007,287.90	10.35
2	002341	新纶科技	130,249,275.67	10.29
3	002539	新都化工	113,925,038.44	9.00
4	600085	同仁堂	98,415,867.36	7.77
5	300093	金刚玻璃	86,513,962.85	6.83
6	002509	天广中茂	80,986,762.78	6.40
7	002584	西陇科学	76,185,639.43	6.02
8	600016	民生银行	68,536,612.00	5.41
9	000333	美的集团	65,690,991.94	5.19
10	601515	东风股份	64,675,518.82	5.11
11	300090	盛运环保	62,147,227.30	4.91
12	600029	南方航空	61,196,958.74	4.83
13	600115	东方航空	60,528,453.38	4.78
14	300146	汤臣倍健	59,495,089.88	4.70
15	300240	飞力达	57,774,266.21	4.56
16	002303	美盈森	57,770,895.27	4.56
17	002123	梦网荣信	56,054,041.00	4.43
18	300097	智云股份	49,403,670.98	3.90
19	002308	威创股份	48,716,669.96	3.85
20	000004	国农科技	48,695,454.86	3.85
21	002673	西部证券	48,397,245.76	3.82
22	002638	勤上光电	48,141,483.18	3.80
23	000972	中基健康	47,538,687.22	3.75
24	000673	当代东方	46,664,286.14	3.69
25	300326	凯利泰	46,414,990.86	3.67
26	600598	北大荒	45,500,317.38	3.59
27	002390	信邦制药	45,445,894.86	3.59
28	002597	金禾实业	45,248,942.14	3.57

29	000651	格力电器	44,309,103.13	3.50
30	002572	索菲亚	42,429,409.61	3.35
31	000587	金洲慈航	40,770,274.86	3.22
32	000055	方大集团	40,470,238.05	3.20
33	603808	歌力思	40,371,776.48	3.19
34	300338	开元仪器	40,341,943.40	3.19
35	601988	中国银行	37,782,944.00	2.98
36	000887	中鼎股份	37,631,254.43	2.97
37	600153	建发股份	36,839,079.81	2.91
38	601318	中国平安	36,317,806.15	2.87
39	600589	广东榕泰	36,256,339.59	2.86
40	600240	华业资本	36,023,513.59	2.84
41	002125	湘潭电化	35,470,445.17	2.80
42	002127	南极电商	34,766,873.28	2.75
43	000568	泸州老窖	34,746,059.91	2.74
44	300260	新莱应材	34,189,244.95	2.70
45	002596	海南瑞泽	34,134,941.99	2.70
46	002010	传化股份	34,105,439.15	2.69
47	000818	方大化工	33,307,913.49	2.63
48	000829	天音控股	32,870,068.87	2.60
49	300035	中科电气	32,138,111.58	2.54
50	601336	新华保险	31,954,936.89	2.52
51	002625	龙生股份	31,950,218.10	2.52
52	300363	博腾股份	31,801,296.99	2.51
53	300364	中文在线	31,735,836.28	2.51
54	300170	汉得信息	31,353,422.22	2.48
55	300238	冠昊生物	31,028,706.98	2.45
56	600300	维维股份	30,414,690.79	2.40
57	300113	顺网科技	30,038,566.20	2.37
58	601177	杭齿前进	29,347,519.91	2.32
59	000026	飞亚达 A	28,664,104.06	2.26
60	002044	美年健康	28,490,779.00	2.25
61	002683	宏大爆破	28,354,417.22	2.24
62	002481	双塔食品	28,279,267.41	2.23
63	300136	信维通信	27,638,981.16	2.18
64	601333	广深铁路	27,609,192.28	2.18
65	300409	道氏技术	26,953,959.05	2.13
66	002355	兴民智通	26,481,545.00	2.09

67	300159	新研股份	26,350,541.95	2.08
68	002537	海立美达	26,350,538.06	2.08
69	300050	世纪鼎利	26,039,645.00	2.06
70	300046	台基股份	26,022,391.36	2.06
71	601555	东吴证券	25,489,738.00	2.01

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,585,219,313.18
卖出股票收入（成交）总额	4,633,039,688.05

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

8.12.2 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	585,259.72
2	应收证券清算款	24,922,960.61
3	应收股利	-
4	应收利息	59,667.41
5	应收申购款	26,794.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,594,681.84

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002509	天广中茂	125,300,000.00	11.03	重大资产重组
2	002659	中泰桥梁	42,656,430.00	3.76	重大资产重组

§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
38,944	16,981.29	75,256,369.10	11.38%	586,062,940.02	88.62%

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	181,975.49	0.0275%

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
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006年11月15日）基金份额总额	3,364,280,448.23
本报告期期初基金份额总额	643,557,409.28
本报告期基金总申购份额	423,062,192.28
减：本报告期基金总赎回份额	405,300,292.44
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	661,319,309.12

§ 11 重大事件揭示**11.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**11.2.1 基金管理人重大人事变动**

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。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动

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

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	2,766,805,161.03	30.04%	2,521,391.29	29.92%	-
中信证券	1	2,410,057,495.85	26.16%	2,196,287.83	26.06%	-
光大证券	1	995,534,323.54	10.81%	907,231.01	10.77%	-
申万宏源	1	708,992,421.34	7.70%	660,283.29	7.84%	-
华西证券	2	579,962,806.01	6.30%	528,521.47	6.27%	-
安信证券	1	383,560,105.78	4.16%	357,212.07	4.24%	-
新时代证券	1	341,718,089.23	3.71%	318,244.02	3.78%	-
中泰证券	1	331,439,371.47	3.60%	302,039.89	3.58%	-
招商证券	1	274,574,137.08	2.98%	250,219.56	2.97%	-
浙商证券	1	263,182,566.96	2.86%	239,842.31	2.85%	-
中信建投	1	75,452,885.85	0.82%	70,268.66	0.83%	-
平安证券	1	62,246,848.83	0.68%	57,970.45	0.69%	-
恒泰证券	1	18,095,199.63	0.20%	16,852.26	0.20%	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	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

本报告期内，中止国开证券交易单元 1 个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	3,662,800,000.00	20.94%	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	4,304,200,000.00	24.61%	-	-
新时代证券	-	-	851,100,000.00	4.87%	-	-
中泰证券	-	-	2,256,000,000.00	12.90%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	3,114,800,000.00	17.81%	-	-
中信建投	-	-	1,398,500,000.00	8.00%	-	-
平安证券	-	-	1,901,500,000.00	10.87%	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-

融通基金管理有限公司

二〇一七年三月三十日