

融通新区域新经济灵活配置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：中国农业银行股份有限公司

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 2017 年 3 月 27 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。

本报告中的财务资料已经审计，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	2,088,858,446.60 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

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、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 5 月 20 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-364,310,094.14	-938,808,986.48
本期利润	-473,029,981.51	-842,947,516.58
加权平均基金份额本期利润	-0.2109	-0.3216
本期基金份额净值增长率	-28.24%	-26.70%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.5144	-0.3561
期末基金资产净值	1,099,002,070.56	1,721,052,478.21
期末基金份额净值	0.526	0.733

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）。

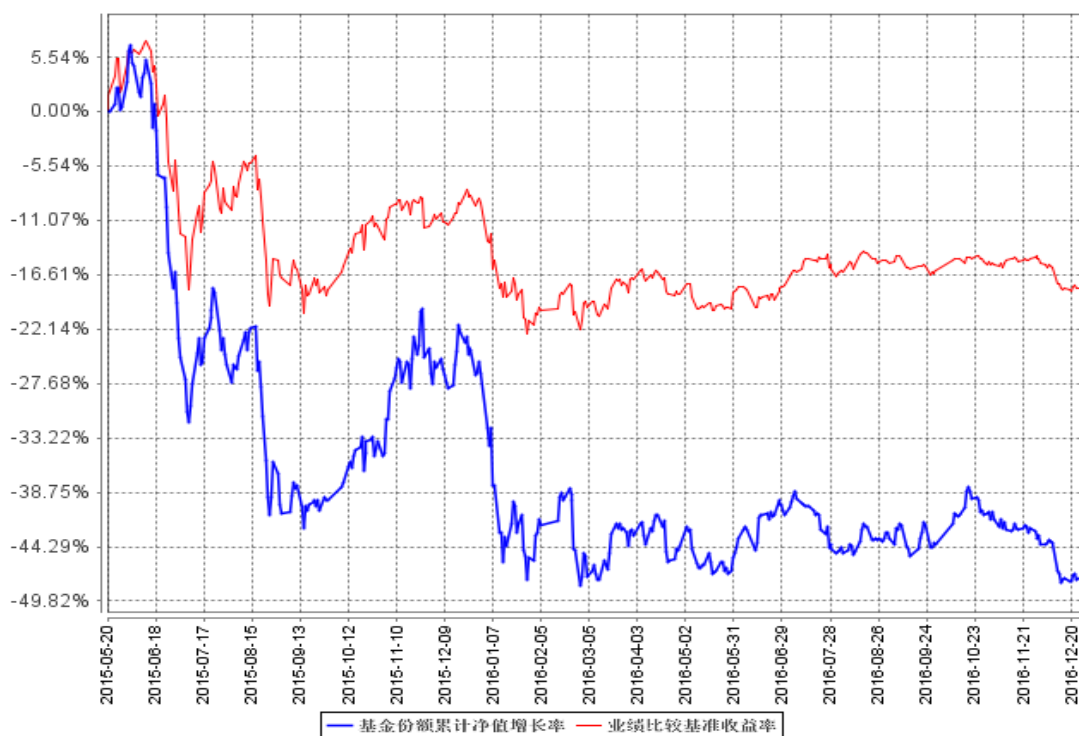
3.2 基金净值表现

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	-5.90%	1.22%	-2.14%	0.41%	-3.76%	0.81%
过去六个月	-11.45%	1.25%	-0.24%	0.45%	-11.21%	0.80%
过去一年	-28.24%	2.05%	-9.50%	0.87%	-18.74%	1.18%
自基金合同生效起至今	-47.40%	2.25%	-17.94%	1.24%	-29.46%	1.01%

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

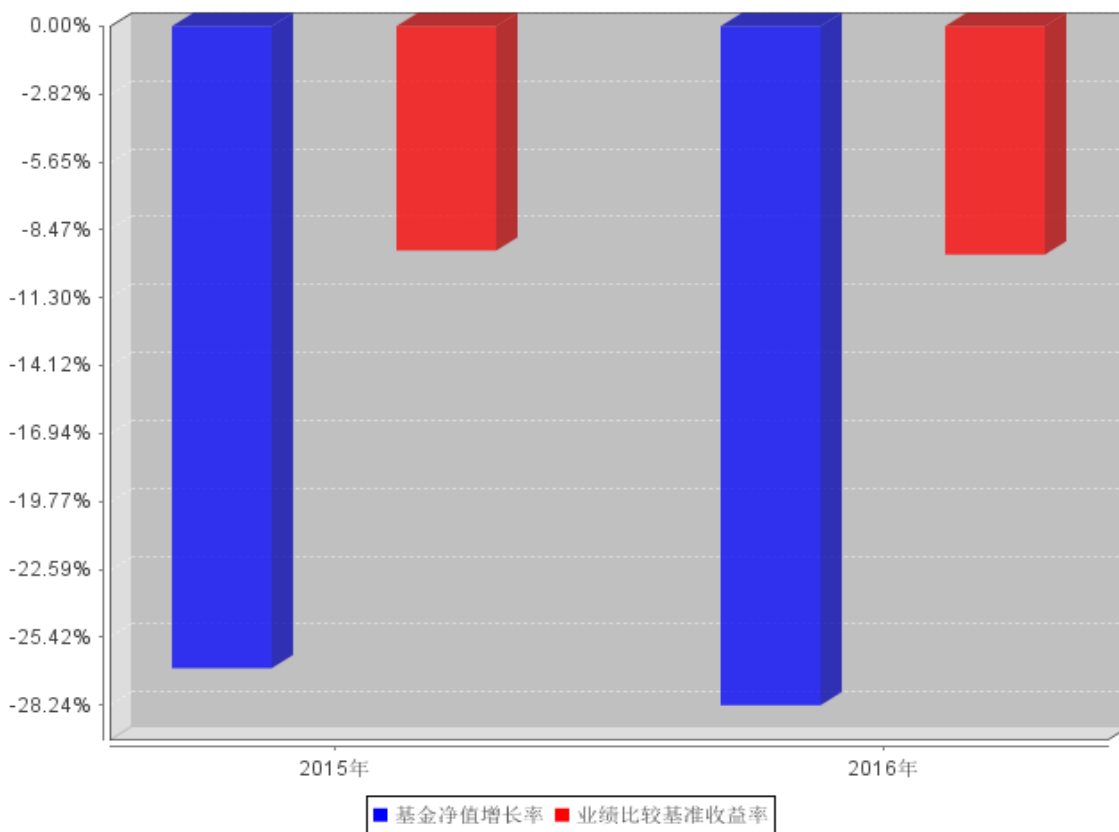
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同生效日为 2015 年 5 月 20 日。

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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 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		
杨博琳	本基金的基金经理	2015 年 5 月 20 日	-	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，现任融通新区域新经济灵活配置混合基金的基金经理。
刘格菘	本基金的基金经理，权益投资部总经理。	2015 年 5 月 20 日	-	6	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，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，现任融通领先成长混合（LOF）、融通互联网传媒灵活配置混合、融通新区域新经济灵活配置混合、融通成长 30 灵活配置混合基金的基金经理。

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的工作时间为计算标准。

2、2017 年 2 月 18 日起，刘格菘不再担任本基金的基金经理，杨博琳先生继续担任本基金的基金经理。具体内容请参阅 2017 年 2 月 18 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》上刊登的相关公告。

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

2016 年，上证综指下跌 12.31%，创业板指下跌 27.71%，大盘蓝筹风格明显优于中小创。1

月份，市场遭遇熔断，市场在短短几个交易日出现大幅下挫，连续出现中小市值股票大面积的跌停。从全年来看，在过去曾被大家忽视的周期、低估值价值、白马成长股全年表现较为出色；成长股在 2 季度有过较好的表现，以新能源汽车、Oled 等为代表。进入下半年，低估值价值股开始轮动，地产、汽车等板块均有表现。

开年受市场熔断影响，本基金最大跌幅近30%。所处的基金分类为灵活配置型基金（仓位范围为0-95%），据基金公开信息分析，年初较多同类型基金的仓位较低，因此下跌受损相比本基金较小。本基金从开年的大幅落后开始慢慢往回追，年中6月、10月表现较好，跌幅都分别追到-15%左右，分别得益于新能源汽车和电商物流的配置策略，取得较大收益。但在之后未能及时止盈，相关板块回调较大，导致本基金的回撤也较大。

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-28.24%，同期业绩比较基准收益率为-9.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中美两国之间的政治博弈、中国面临的宏观环境使得 2017 年依然会是一个大幅波动的年份。从股市层面来看，流动性进一步宽松的空间很小，如果利率没有进一步下降空间，本质上也可以认为现在已经进入了利率上行的周期，只不过这一周期会因经济、物价、汇率等因素而变得较为复杂，当前环境下，立即进入加息周期的可能性不大，股市向下大的风险目前来看并不具备。不过依靠估值扩张推动的上涨行情也难以看到。2017 年，主要关注分子端的预期变化带来的投资机会。我们认为：业绩高增长、估值合理的成长股，以及供求格局边际改善带来的业绩超预期的周期股为首选。此外，改革预期的板块依然值得关注，包括国企改革、一带一路等板块。

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。

§ 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 12 月 31 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 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 21214 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 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	219,569,658.06	226,506,226.45
结算备付金	4,556,829.93	14,488,087.18
存出保证金	1,516,631.44	5,042,489.87
交易性金融资产	882,071,589.64	1,335,082,214.69
其中：股票投资	882,071,589.64	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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	5,401,414.00	151,336,301.31
应收利息	26,121.33	53,631.16
应收股利	-	-
应收申购款	173,272.20	222,632.18
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,113,315,516.60	1,732,731,582.84
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	9,815,764.64	-
应付赎回款	596,548.84	2,956,588.15
应付管理人报酬	1,439,545.69	2,263,149.89
应付托管费	239,924.29	377,191.62
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,120,424.24	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	101,238.34	111,755.90
负债合计	14,313,446.04	11,679,104.63
所有者权益：		
实收基金	2,088,858,446.60	2,348,993,316.54
未分配利润	-989,856,376.04	-627,940,838.33
所有者权益合计	1,099,002,070.56	1,721,052,478.21
负债和所有者权益总计	1,113,315,516.60	1,732,731,582.84

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值为 0.526 元，基金份额总额 2,088,858,446.60 份。

7.2 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 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 5 月 20 日(基金合同生效 日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	-425,651,181.33	-800,697,581.07
1. 利息收入	1,806,435.40	3,834,255.57
其中：存款利息收入	1,672,848.82	3,834,255.57
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	133,586.58	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益	-319,137,518.31	-902,799,942.90
其中：股票投资收益	-323,521,004.36	-905,327,685.77
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	4,383,486.05	2,527,742.87
3. 公允价值变动收益	-108,719,887.37	95,861,469.90
4. 汇兑收益	-	-
5. 其他收入	399,788.95	2,406,636.36
减：二、费用	47,378,800.18	42,249,935.51
1. 管理人报酬	19,202,900.20	18,481,909.96

2. 托管费	3,200,483.41	3,080,318.27
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	24,539,202.29	20,416,177.27
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	436,214.28	271,530.01
三、利润总额	-473,029,981.51	-842,947,516.58
减：所得税费用	-	-
四、净利润	-473,029,981.51	-842,947,516.58

7.3 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 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）	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）	-	-473,029,981.51	-473,029,981.51
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-260,134,869.94	111,114,443.80	-149,020,426.14
其中：1. 基金申购款	147,204,049.71	-62,319,264.10	84,884,785.61
2. 基金赎回款	-407,338,919.65	173,433,707.90	-233,905,211.75
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）	2,088,858,446.60	-989,856,376.04	1,099,002,070.56
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 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,161,231,163.54	-	3,161,231,163.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-842,947,516.58	-842,947,516.58
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-812,237,847.00	215,006,678.25	-597,231,168.75
其中：1. 基金申购款	133,797,683.11	-33,099,271.43	100,698,411.68
2. 基金赎回款	-946,035,530.11	248,105,949.68	-697,929,580.43

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）	2,348,993,316.54	-627,940,838.33	1,721,052,478.21

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。

7.4.2 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（“融通基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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

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5月20日（基金合同生效日）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	757,906,579.57	4.64%	-	-

7.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.4.1.3 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	690,682.12	4.63%	198,520.82	9.37%
关联方名称	上年度可比期间 2015年5月20日（基金合同生效日）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	-	-	-	-

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5月20日（基金合同生效日） 至2015年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	19,202,900.20
其中：支付销售机构的客户维护费	10,638,774.21	10,193,389.89

注：1、支付基金管理人融通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

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

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 5 月 20 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,200,483.41	3,080,318.27

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：

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

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内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。

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可比期间，除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金份额。

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 5 月 20 日(基金合同生效日)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
中国农业银行	219,569,658.06	1,508,074.16	226,506,226.45	3,716,309.67

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。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002635	安洁科技	2016-11-8	重大资产重组	36.40	2017-2-8	33.50	699,965	25,221,847.50	25,478,726.00	-
300450	先导智能	2016-11-15	重大资产重组	33.99	2017-2-8	33.00	699,969	23,845,655.46	23,791,946.31	-
300213	佳讯飞鸿	2016-11-4	重大资产重组	28.00	2017-2-17	25.48	299,945	8,132,719.36	8,398,460.00	-
300496	中科创达	2016-10-11	重大资产重组	52.28	2017-1-6	47.49	100,000	5,220,101.04	5,228,000.00	-

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。

7.4.5.3 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	882,071,589.64	79.23
	其中：股票	882,071,589.64	79.23
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	224,126,487.99	20.13
7	其他各项资产	7,117,438.97	0.64
8	合计	1,113,315,516.60	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	59,016,236.06	5.37
B	采矿业	21,090,000.00	1.92
C	制造业	607,185,427.27	55.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	83,167,716.03	7.57
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	24,339,493.60	2.21
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	75,727,716.68	6.89
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	11,545,000.00	1.05
S	综合	-	-
	合计	882,071,589.64	80.26

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	002127	南极电商	6,596,491	75,727,716.68	6.89
2	300207	欣旺达	4,749,786	66,022,025.40	6.01
3	002120	新海股份	1,250,223	63,011,239.20	5.73
4	600146	商赢环球	1,599,944	54,158,104.40	4.93
5	300156	神雾环保	2,099,713	52,513,822.13	4.78
6	300340	科恒股份	958,817	50,922,770.87	4.63
7	300202	聚龙股份	1,879,893	46,245,367.80	4.21
8	000998	隆平高科	1,899,982	40,716,614.26	3.70
9	002529	海源机械	1,699,784	35,933,433.76	3.27
10	601668	中国建筑	3,263,439	28,914,069.54	2.63

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	300073	当升科技	200,350,285.90	11.64
2	300340	科恒股份	166,609,062.48	9.68
3	300364	中文在线	113,909,470.65	6.62
4	300520	科大国创	110,423,497.05	6.42
5	300202	聚龙股份	107,550,585.34	6.25
6	002120	新海股份	98,990,387.67	5.75
7	002108	沧州明珠	90,579,108.75	5.26
8	300078	思创医惠	88,196,994.93	5.12
9	002533	金杯电工	81,008,951.02	4.71
10	601688	华泰证券	79,908,628.63	4.64
11	300207	欣旺达	79,166,517.32	4.60
12	600519	贵州茅台	77,311,545.15	4.49
13	002766	索菱股份	75,769,004.52	4.40

14	300153	科泰电源	74,930,885.15	4.35
15	000858	五粮液	74,485,053.42	4.33
16	002245	澳洋顺昌	69,878,559.05	4.06
17	600219	南山铝业	68,726,182.63	3.99
18	300014	亿纬锂能	68,012,147.41	3.95
19	000596	古井贡酒	67,783,708.33	3.94
20	300007	汉威电子	67,488,900.21	3.92
21	002410	广联达	67,161,871.31	3.90
22	300168	万达信息	66,706,831.99	3.88
23	002709	天赐材料	66,176,465.84	3.85
24	300263	隆华节能	64,968,922.07	3.77
25	600110	诺德股份	62,969,218.61	3.66
26	002517	恺英网络	61,339,862.35	3.56
27	300033	同花顺	60,646,905.25	3.52
28	002468	艾迪西	59,213,954.56	3.44
29	002640	跨境通	57,756,482.62	3.36
30	002537	海立美达	57,467,728.68	3.34
31	000818	方大化工	55,926,214.24	3.25
32	300310	宜通世纪	55,464,380.82	3.22
33	000568	泸州老窖	54,406,482.75	3.16
34	600386	北巴传媒	54,291,929.05	3.15
35	600146	商赢环球	54,149,447.82	3.15
36	300156	神雾环保	53,983,222.49	3.14
37	300008	天海防务	52,959,866.87	3.08
38	300253	卫宁健康	48,809,967.26	2.84
39	300467	迅游科技	48,300,327.44	2.81
40	600622	嘉宝集团	48,151,184.16	2.80
41	300141	和顺电气	47,550,903.32	2.76
42	600419	天润乳业	47,476,934.95	2.76
43	601689	拓普集团	46,936,970.77	2.73
44	002466	天齐锂业	46,104,809.22	2.68
45	601668	中国建筑	45,912,495.32	2.67
46	601633	长城汽车	45,747,383.53	2.66
47	600115	东方航空	45,236,287.94	2.63
48	002551	尚荣医疗	44,145,035.29	2.57
49	001979	招商蛇口	43,941,169.17	2.55
50	000700	模塑科技	43,043,967.54	2.50
51	600476	湘邮科技	42,830,375.00	2.49
52	002329	皇氏集团	42,095,021.88	2.45
53	002529	海源机械	41,962,553.02	2.44
54	600029	南方航空	41,920,159.75	2.44
55	600198	大唐电信	41,765,253.58	2.43

56	600485	信威集团	41,662,530.95	2.42
57	002284	亚太股份	41,509,781.10	2.41
58	000998	隆平高科	41,368,805.44	2.40
59	002165	红宝丽	41,282,170.36	2.40
60	600730	中国高科	40,800,733.83	2.37
61	002547	春兴精工	40,112,668.27	2.33
62	300336	新文化	40,100,091.84	2.33
63	300352	北信源	39,982,856.57	2.32
64	300027	华谊兄弟	39,943,486.68	2.32
65	000793	华闻传媒	39,865,279.41	2.32
66	600075	新疆天业	39,784,680.66	2.31
67	000783	长江证券	39,653,896.35	2.30
68	002479	富春环保	39,547,615.19	2.30
69	300101	振芯科技	39,533,103.29	2.30
70	002271	东方雨虹	39,492,828.80	2.29
71	600446	金证股份	39,489,688.80	2.29
72	002224	三力士	39,366,586.21	2.29
73	300085	银之杰	39,112,639.94	2.27
74	002358	森源电气	38,988,776.66	2.27
75	000626	如意集团	38,974,617.28	2.26
76	002313	日海通讯	38,824,351.57	2.26
77	300259	新天科技	38,740,505.65	2.25
78	002264	新华都	38,623,233.67	2.24
79	300098	高新兴	38,520,121.11	2.24
80	300115	长盈精密	38,226,435.41	2.22
81	300075	数字政通	37,874,419.78	2.20
82	600221	海南航空	37,465,564.60	2.18
83	002094	青岛金王	37,331,005.35	2.17
84	601777	力帆股份	37,300,717.94	2.17
85	600233	圆通速递	36,926,448.45	2.15
86	603020	爱普股份	36,792,586.00	2.14
87	300431	暴风集团	36,262,857.48	2.11
88	000034	神州数码	35,938,326.44	2.09
89	300166	东方国信	35,419,412.56	2.06
90	600188	兖州煤业	35,241,880.61	2.05
91	300088	长信科技	35,220,443.26	2.05
92	000606	*ST 易桥	34,646,764.68	2.01
93	300213	佳讯飞鸿	34,560,351.33	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	300073	当升科技	176,548,262.66	10.26
2	300008	天海防务	168,991,525.63	9.82
3	300202	聚龙股份	127,351,177.16	7.40
4	300364	中文在线	116,747,146.31	6.78
5	300340	科恒股份	115,177,762.50	6.69
6	600446	金证股份	91,557,689.64	5.32
7	300520	科大国创	90,728,221.69	5.27
8	300153	科泰电源	90,260,907.58	5.24
9	002085	万丰奥威	87,722,274.54	5.10
10	600519	贵州茅台	79,529,851.83	4.62
11	002599	盛通股份	79,056,395.58	4.59
12	601688	华泰证券	77,938,380.00	4.53
13	600485	信威集团	76,999,193.57	4.47
14	002766	索菱股份	76,329,572.19	4.44
15	002533	金杯电工	75,963,949.06	4.41
16	000858	五粮液	75,668,282.25	4.40
17	600219	南山铝业	75,171,952.31	4.37
18	300078	思创医惠	73,388,330.07	4.26
19	002709	天赐材料	73,038,590.03	4.24
20	002343	慈文传媒	72,804,269.96	4.23
21	002667	鞍重股份	72,261,660.33	4.20
22	300014	亿纬锂能	71,474,757.44	4.15
23	600110	诺德股份	71,160,207.18	4.13
24	300007	汉威电子	70,346,647.12	4.09
25	002410	广联达	69,401,598.32	4.03
26	002640	跨境通	68,835,060.64	4.00
27	002517	恺英网络	67,979,475.30	3.95
28	300025	华星创业	67,665,484.05	3.93
29	300168	万达信息	66,378,090.60	3.86
30	002108	沧州明珠	64,973,844.23	3.78
31	300467	迅游科技	64,828,751.95	3.77
32	002245	澳洋顺昌	64,644,070.95	3.76
33	000596	古井贡酒	62,328,555.27	3.62
34	002468	艾迪西	61,132,640.92	3.55
35	002120	新海股份	60,553,311.40	3.52
36	002537	海立美达	60,385,500.45	3.51
37	000818	方大化工	58,683,878.53	3.41
38	300033	同花顺	58,349,952.07	3.39
39	000606	*ST 易桥	58,178,609.12	3.38
40	600233	圆通速递	58,121,870.82	3.38
41	300310	宜通世纪	57,540,442.75	3.34

42	300263	隆华节能	55,823,382.13	3.24
43	300141	和顺电气	55,537,711.95	3.23
44	600419	天润乳业	55,430,262.87	3.22
45	002127	南极电商	55,165,929.20	3.21
46	600386	北巴传媒	54,928,937.17	3.19
47	300253	卫宁健康	51,214,901.37	2.98
48	600622	嘉宝集团	50,431,755.88	2.93
49	300342	天银机电	49,836,617.02	2.90
50	000568	泸州老窖	49,542,118.43	2.88
51	601633	长城汽车	48,165,549.68	2.80
52	300075	数字政通	45,713,921.80	2.66
53	002547	春兴精工	45,355,269.04	2.64
54	001979	招商蛇口	44,687,516.72	2.60
55	002329	皇氏集团	44,241,788.62	2.57
56	002165	红宝丽	43,694,455.64	2.54
57	600115	东方航空	43,403,381.38	2.52
58	600476	湘邮科技	43,348,237.08	2.52
59	601689	拓普集团	42,734,875.28	2.48
60	000783	长江证券	42,486,174.98	2.47
61	300021	大禹节水	41,203,914.20	2.39
62	300259	新天科技	40,875,396.89	2.38
63	300098	高新兴	40,832,238.03	2.37
64	300085	银之杰	40,685,218.82	2.36
65	002094	青岛金王	40,357,192.83	2.34
66	002271	东方雨虹	40,342,561.80	2.34
67	600730	中国高科	39,170,419.31	2.28
68	300088	长信科技	39,131,333.78	2.27
69	002479	富春环保	39,007,777.86	2.27
70	002466	天齐锂业	38,978,202.29	2.26
71	000626	如意集团	38,562,607.02	2.24
72	300101	振芯科技	38,525,272.75	2.24
73	000700	模塑科技	38,521,229.50	2.24
74	600029	南方航空	38,354,371.35	2.23
75	002224	三力士	38,255,521.55	2.22
76	600198	大唐电信	38,156,580.22	2.22
77	000985	大庆华科	37,821,425.80	2.20
78	002551	尚荣医疗	37,643,281.76	2.19
79	601777	力帆股份	37,122,636.09	2.16
80	600221	海南航空	36,486,127.60	2.12
81	002313	日海通讯	36,292,040.80	2.11
82	300027	华谊兄弟	36,186,374.41	2.10
83	000421	南京公用	36,154,885.92	2.10

84	600075	新疆天业	36,106,015.39	2.10
85	002316	键桥通讯	35,831,454.62	2.08
86	000793	华闻传媒	35,544,381.76	2.07
87	300336	新文化	35,428,227.47	2.06
88	300431	暴风集团	35,394,176.49	2.06
89	002284	亚太股份	35,058,027.31	2.04
90	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。

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	8,150,362,245.11
卖出股票收入（成交）总额	8,171,131,978.43

注：“买入股票成本（成交）总额”和“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持有股指期货。

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持有国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

8.12.2 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,516,631.44
2	应收证券清算款	5,401,414.00
3	应收股利	-
4	应收利息	26,121.33
5	应收申购款	173,272.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,117,438.97

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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

29,505	70,796.76	4,513,968.12	0.22%	2,084,344,478.48	99.78%
--------	-----------	--------------	-------	------------------	--------

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	376,723.77	0.0180%

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（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	147,204,049.71
减：本报告期基金总赎回份额	407,338,919.65
本报告期期末基金份额总额	2,088,858,446.60

§ 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

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变更。

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

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	
申万宏源	1	5,651,437,571.27	34.63%	5,150,159.72	34.52%	-
海通证券	2	4,513,326,881.32	27.65%	4,112,986.62	27.57%	-
中信证券	1	2,320,468,218.28	14.22%	2,161,051.11	14.48%	-
东兴证券	1	1,725,723,901.69	10.57%	1,572,654.35	10.54%	-
招商证券	1	1,048,618,811.49	6.42%	955,608.46	6.40%	-
新时代证券	1	757,906,579.57	4.64%	690,682.12	4.63%	-
国泰君安	1	304,012,259.92	1.86%	277,046.65	1.86%	-

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

无。

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

二〇一七年三月三十日