

融通新消费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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 30 日

## 1.1 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据融通新消费灵活配置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 28 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 5 月 27 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	融通新消费灵活配置混合
基金主代码	002605
前端交易代码	002605
后端交易代码	002606
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 5 月 27 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	52,620,911.82 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于新消费主题相关优质上市公司，同时通过合理的动态资产配置，在注重风险控制的原则下，追求超越基金业绩比较基准的长期稳定资本增值。
投资策略	本基金的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、货币市场工具等的比例进

	行大类资产配置，规避系统性风险，力争通过资产配置获得部分超额收益。
业绩比较基准	中证全指主要消费指数收益率×50%+中债综合全价（总值）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
法定代表人		高峰	王洪章

## 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	<a href="http://www.rtfund.com">http://www.rtfund.com</a>
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5月27日(基金合同生效日)-2016年12月31日
本期已实现收益	6,702,484.57
本期利润	6,496,326.54
加权平均基金份额本期利润	0.0585
本期基金份额净值增长率	3.80%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末
期末可供分配基金份额利润	0.0379
期末基金资产净值	54,617,289.23
期末基金份额净值	1.038

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）。

4、本基金合同生效日为 2016 年 5 月 27 日。

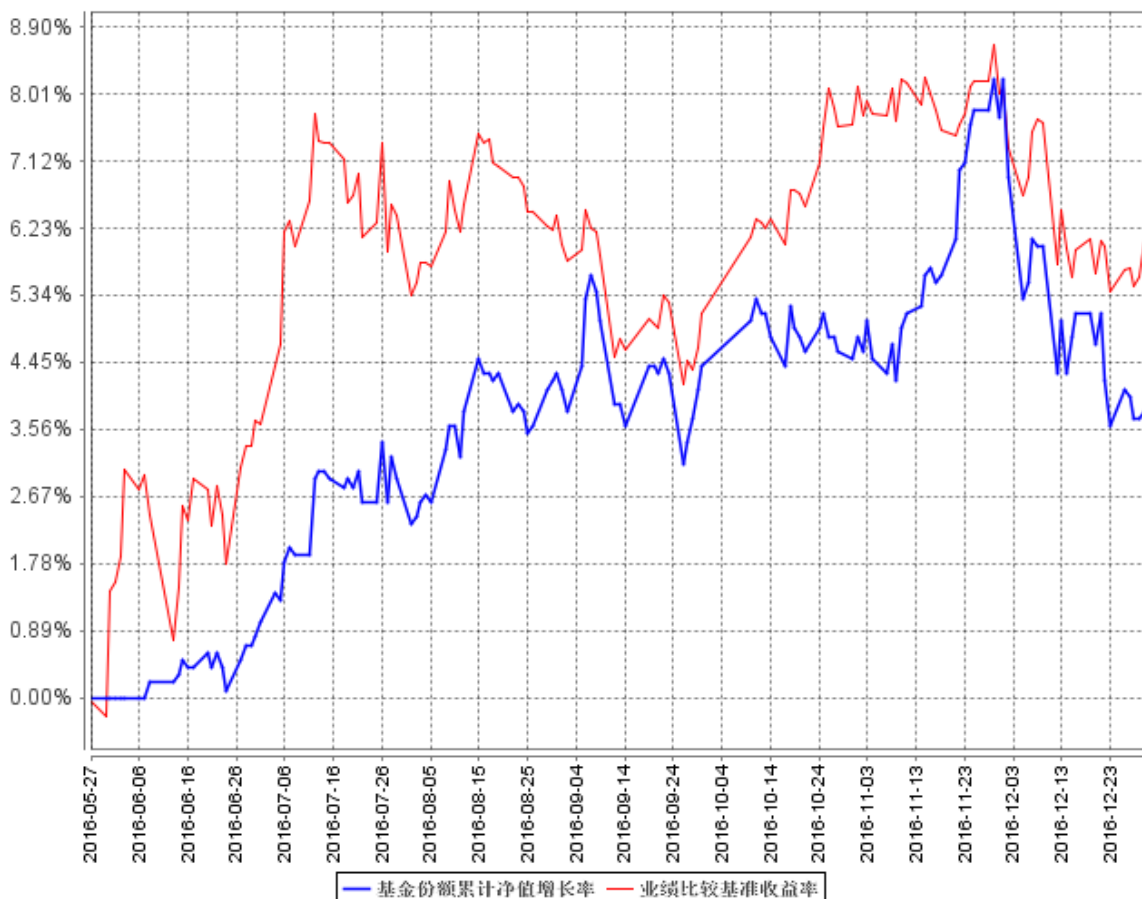
### 3.2 基金净值表现

#### 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	-0.57%	0.49%	0.90%	0.42%	-1.47%	0.07%
过去六个月	2.98%	0.45%	2.30%	0.46%	0.68%	-0.01%
自基金合同生效起至今	3.80%	0.42%	6.06%	0.51%	-2.26%	-0.09%

#### 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

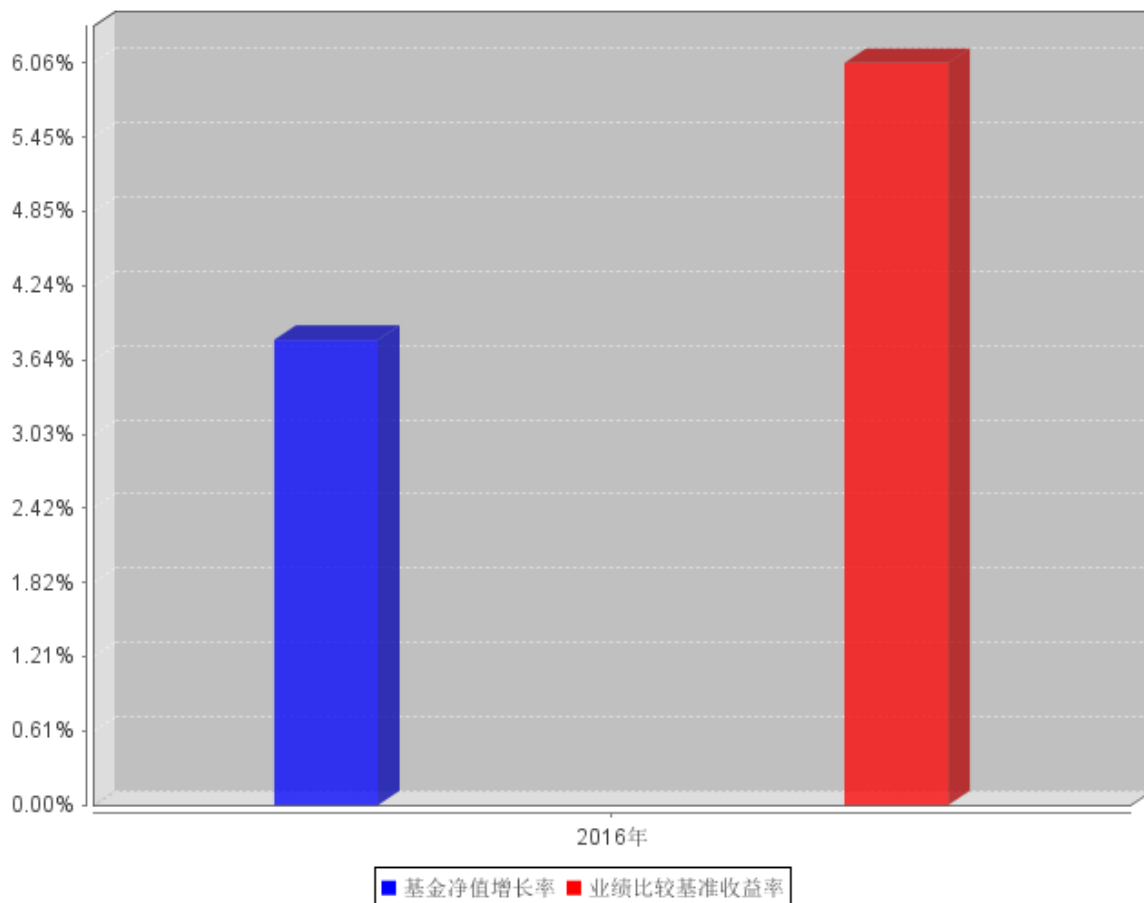


注：（1）本基金的基金合同生效日为 2016 年 5 月 27 日，至报告期末基金合同生效未满 1 年。

（2）本基金建仓期为六个月，至建仓期结束，各项资产配置比例符合合同规定。

### 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：上图所示 2016 年度数据统计期为 2016 年 5 月 27 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日，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	-	-	-	-	
合计	-	-	-	-	

注：本基金合同生效日为 2016 年 5 月 27 日。

## § 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		
商小虎	本基金的基金经理，投资总监。	2016 年 5 月 27 日	-	15	商小虎先生，上海社会科学院经济学博士、澳门大学及上海社会科学院经济学硕士、复旦大学经济学学士，

					美国特许金融分析师 (CFA)，15 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投资总监。历任日本东京三菱银行旗下和昇证券公司行业分析员、上海国际集团(原上海国有资产经营有限公司)投资经理、上海国际集团香港子公司副总经理、中银国际证券公司资产管理部副总经理。2015 年 1 月加入融通基金管理有限公司，现任融通跨界成长灵活配置混合、融通中国风 1 号灵活配置混合、融通新消费灵活配置混合、融通国企改革新机遇灵活配置混合、融通沪港深智慧生活灵活配置混合基金的基金经理。
关山	本基金的基金经理。	2016 年 6 月 3 日	-	10	关山女士，英国帝国理工大学金融学硕士、英国伯明翰大学经济学学士，10 年证券投资从业经历，具有基金从业资格。2006 年 3 月加入融通基金，历任纺织服装、餐饮旅游行业研究员、轻工制造行业研究员、消费组组长。2016 年 6 月 3 日起至今任“融通新消费灵活配置混合型证券投资基金”基金经理。

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，此后的非首任基金经理，任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写；

2、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。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 年全年上证指数下跌 12.31%，创业板指数下跌 27.71%。本基金是 5 月 27 日成立，在风险偏好下降的背景下，整个消费品板块（按照申万一级行业划分）在上半年已有不错的表现，例如白酒，家电，家装等。考虑到当时实际利率水平不断走低的宏观环境，高分红、低估值、盈利稳定的企业价值被重估，我们在市场震荡过程中逐步建仓配置了消费细分领域的龙头公司。坚持配置基本面过硬，安全边际高的行业和个股是我们始终遵循的原则。同时在市场调整过程中，积极跟进新兴产业的变化，做好研究布局，储备一些成长性良好，或治理结构发生改变的潜在标的。我们紧跟市场热点，对于年底提出的农业供给侧改革政策，新零售概念，也积极布局寻找投资机会。

#### 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 3.80%，同期业绩比较基准收益率为 6.06%。



#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在当前时点展望 2017 年，我们面临深化改革和政府换届，预计经济整体增速稳中略降。16 年居民加杠杆，房地产销售持续高增长，十月后各地地产调控措施陆续出台，考虑到销售带动投资和新开工的时滞，后续地产投资增速存在向下的不确定性。当前制造业投资可能在盈利改善和补库需求拉动下态度积极，但企业经过多年的周期波动，更趋理性，投资热情的持续性存有不确定性。如果经济下行压力突显，财政支出和基建投资很可能加大，以维持全年经济增长 6.5% 的目标，所以我们对整体经济环境保持积极的态度。对于消费品行业，除了具有经济后周期属性外，人口结构的变化，生活习惯的变化，消费升级的逐步推进，使得各个细分子板块机会迭代型出现。

#### 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

本基金本报告期末未进行利润分配，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

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合规守信、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。

报告期内，本基金未实施利润分配。

## 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 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 21169 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：融通新消费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
<b>资 产：</b>	
银行存款	26,129,413.48
结算备付金	334,487.83
存出保证金	67,644.62
交易性金融资产	30,027,951.62
其中：股票投资	30,027,951.62
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	20,000,000.00
应收证券清算款	570,624.09
应收利息	6,317.44
应收股利	-
应收申购款	2,472.72
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	77,138,911.80
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016年12月31日</b>
<b>负 债:</b>	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	22,181,698.42
应付赎回款	31,868.75
应付管理人报酬	73,821.23
应付托管费	12,303.53
应付销售服务费	-
应付交易费用	171,814.42
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	50,116.22
负债合计	22,521,622.57
<b>所有者权益:</b>	
实收基金	52,620,911.82
未分配利润	1,996,377.41
所有者权益合计	54,617,289.23
负债和所有者权益总计	77,138,911.80

注：1. 报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.038 元，基金份额总额 52,620,911.82 份。

2. 本基金合同生效日为 2016 年 5 月 27 日，2016 年度实际报告期间为 2016 年 5 月 27 日至 2016 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

## 7.2 利润表

会计主体：融通新消费灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 5 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2016 年 5 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
<b>一、收入</b>	8,658,083.79		
1. 利息收入	366,603.68		
其中：存款利息收入	366,225.21		
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	378.47		
其他利息收入	-		
2. 投资收益	7,020,478.25		
其中：股票投资收益	6,705,672.52		
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	314,805.73		
3. 公允价值变动收益	-206,158.03		
4. 汇兑收益	-		
5. 其他收入	1,477,159.89		
<b>减：二、费用</b>	2,161,757.25		
1. 管理人报酬	1,018,665.59		
2. 托管费	169,777.57		
3. 销售服务费	-		
4. 交易费用	856,828.55		
5. 利息支出	-		
其中：卖出回购金融资产支出	-		
6. 其他费用	116,485.54		
<b>三、利润总额</b>	6,496,326.54		
减：所得税费用	-		
<b>四、净利润</b>	6,496,326.54		

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通新消费灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 5 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 5 月 27 日(基金合同生效日)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)	315,950,659.67	-	315,950,659.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,496,326.54	6,496,326.54
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-263,329,747.85	-4,499,949.13	-267,829,696.98
其中：1. 基金申购款	9,377,538.17	340,630.02	9,718,168.19
2. 基金赎回款	-272,707,286.02	-4,840,579.15	-277,547,865.17
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)	52,620,911.82	1,996,377.41	54,617,289.23

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 基金基本情况

融通新消费灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]538 号《关于融通新消费灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由融通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通新消费灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 315,879,567.45 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 683 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《融通新消费灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 5 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 315,950,659.67 份基金份额,其中认购资金利息折合 71,092.22 份基金份额。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通新消费灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会批准发行上市的股票)、固定收益类资产(国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、资产支持证券、质押及买断式债券回购、货币市场工具等)、衍生工具(权证、股指期货等)以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。本基金投资组合中,本股票资产占基

金资产的比例为 0%-95%，其余资产投资于债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金投资于新消费相关上市公司证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金业绩比较基准为：中证全指主要消费指数收益率×50%+中债综合全价(总值)指数收益率×50%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《融通新消费灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年 5 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 5 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 5 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以

公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公



允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若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，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》

提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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，对国债、地方

政府债以及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，股票的股息、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，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。

#### 7.4.7 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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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
深圳市融通资本财富管理有限公司(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。

#### 7.4.8 本报告期的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

###### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 5 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,018,665.59
其中：支付销售机构的客户维护费	606,579.42

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50% / 当年天数。

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

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	
	2016 年 5 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
当期发生的基金应支付的托管费	169,777.57	

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。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.8.4.2 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，基金管理人主要股东及其控制的机构未持有本基金份额。

#### 7.4.8.5 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	
	2016 年 5 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	26,129,413.48	358,112.64

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。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金本报告期末未买入管理人、托管人的控股股东在承销期内担任副主承销商或分销商所承销的证券；

2、本基金本报告期末未买入管理人、托管人的主要股东（非控股）在承销期承销的证券。

#### 7.4.8.7 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。

#### 7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 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。

##### 7.4.9.2 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 年 11 月 8 日	重大资产重组	36.40	2017 年 2 月 8 日	33.50	21,300	747,082.80	775,320.00	-

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。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 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。

###### 7.4.9.3.2 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	30,027,951.62	38.93
	其中：股票	30,027,951.62	38.93
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	20,000,000.00	25.93
	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	26,463,901.31	34.31
7	其他各项资产	647,058.87	0.84
8	合计	77,138,911.80	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,196,496.98	4.02
B	采矿业	-	-
C	制造业	17,344,017.00	31.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	819,839.90	1.50
F	批发和零售业	8,124,327.74	14.88
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,543,270.00	2.83
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	30,027,951.62	54.98

### 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	002640	跨境通	136,026	2,489,275.80	4.56
2	600519	贵州茅台	6,100	2,038,315.00	3.73
3	600691	阳煤化工	462,700	1,776,768.00	3.25
4	603008	喜临门	90,500	1,656,150.00	3.03
5	000501	鄂武商A	83,400	1,627,968.00	2.98
6	000861	海印股份	318,200	1,543,270.00	2.83

7	002217	合力泰	84,600	1,514,340.00	2.77
8	002570	贝因美	111,200	1,458,944.00	2.67
9	000925	众合科技	57,600	1,415,232.00	2.59
10	000333	美的集团	48,700	1,371,879.00	2.51

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002303	美盈森	9,156,725.00	16.77
2	002701	奥瑞金	8,256,078.63	15.12
3	600298	安琪酵母	6,454,084.30	11.82
4	600887	伊利股份	6,447,333.00	11.80
5	002032	苏泊尔	6,192,791.80	11.34
6	600519	贵州茅台	5,697,364.10	10.43
7	002458	益生股份	5,548,137.00	10.16
8	002271	东方雨虹	5,534,399.13	10.13
9	600697	欧亚集团	5,336,768.76	9.77
10	600626	申达股份	5,176,005.96	9.48
11	002234	民和股份	4,654,099.00	8.52
12	600104	上汽集团	4,615,279.84	8.45
13	300160	秀强股份	4,452,918.33	8.15
14	600900	长江电力	4,217,996.50	7.72
15	300146	汤臣倍健	4,187,728.60	7.67
16	000158	常山股份	4,185,040.60	7.66
17	300351	永贵电器	4,010,725.45	7.34
18	000888	峨眉山 A	4,009,408.00	7.34
19	600612	老凤祥	3,947,928.40	7.23
20	600801	华新水泥	3,885,525.30	7.11
21	600409	三友化工	3,872,940.75	7.09
22	000429	粤高速 A	3,849,593.19	7.05
23	002563	森马服饰	3,829,901.50	7.01
24	600138	中青旅	3,734,977.40	6.84
25	002394	联发股份	3,651,117.19	6.68

26	002640	跨境通	3,573,537.00	6.54
27	600963	岳阳林纸	3,508,382.00	6.42
28	000925	众合科技	3,385,573.46	6.20
29	600446	金证股份	3,240,188.00	5.93
30	600694	大商股份	3,205,728.59	5.87
31	002714	牧原股份	3,161,487.23	5.79
32	600054	黄山旅游	3,160,318.00	5.79
33	002385	大北农	3,128,016.18	5.73
34	002302	西部建设	3,113,742.78	5.70
35	002229	鸿博股份	3,041,290.00	5.57
36	000039	中集集团	2,978,877.00	5.45
37	002043	兔宝宝	2,881,037.50	5.27
38	600168	武汉控股	2,808,885.87	5.14
39	603609	禾丰牧业	2,718,931.19	4.98
40	601607	上海医药	2,677,366.45	4.90
41	600535	天士力	2,666,728.81	4.88
42	002678	珠江钢琴	2,629,081.18	4.81
43	600036	招商银行	2,594,523.04	4.75
44	000861	海印股份	2,582,875.00	4.73
45	002480	新筑股份	2,493,790.00	4.57
46	000998	隆平高科	2,470,960.00	4.52
47	002050	三花股份	2,369,191.99	4.34
48	600978	宜华生活	2,369,159.00	4.34
49	601339	百隆东方	2,349,833.00	4.30
50	601766	中国中车	2,321,642.00	4.25
51	300144	宋城演艺	2,239,327.00	4.10
52	601169	北京银行	2,238,510.00	4.10
53	000069	华侨城 A	2,237,993.00	4.10
54	002217	合力泰	2,207,291.00	4.04
55	300011	鼎汉技术	2,086,895.00	3.82
56	002677	浙江美大	2,075,891.62	3.80
57	002646	青青稞酒	2,038,165.00	3.73
58	600276	恒瑞医药	1,995,202.20	3.65
59	600498	烽火通信	1,992,655.00	3.65
60	300342	天银机电	1,963,404.00	3.59
61	600567	山鹰纸业	1,863,260.00	3.41



62	600674	川投能源	1,844,600.00	3.38
63	000651	格力电器	1,841,880.00	3.37
64	601688	华泰证券	1,820,000.00	3.33
65	603008	喜临门	1,812,952.00	3.32
66	603818	曲美家居	1,809,144.00	3.31
67	600585	海螺水泥	1,782,252.00	3.26
68	300094	国联水产	1,761,758.54	3.23
69	002404	嘉欣丝绸	1,761,226.00	3.22
70	600691	阳煤化工	1,748,056.00	3.20
71	000501	鄂武商 A	1,743,504.04	3.19
72	600336	澳柯玛	1,729,211.40	3.17
73	300203	聚光科技	1,679,004.00	3.07
74	603000	人民网	1,678,663.00	3.07
75	000921	海信科龙	1,671,200.00	3.06
76	002507	涪陵榨菜	1,644,464.35	3.01
77	000818	方大化工	1,625,542.00	2.98
78	600289	亿阳信通	1,623,438.00	2.97
79	601633	长城汽车	1,613,196.00	2.95
80	002308	威创股份	1,613,141.78	2.95
81	002078	太阳纸业	1,588,675.00	2.91
82	601800	中国交建	1,552,932.54	2.84
83	600816	安信信托	1,540,770.00	2.82
84	603611	诺力股份	1,515,270.00	2.77
85	300346	南大光电	1,492,803.40	2.73
86	002570	贝因美	1,429,773.00	2.62
87	601998	中信银行	1,421,882.00	2.60
88	300164	通源石油	1,410,057.83	2.58
89	300059	东方财富	1,408,120.00	2.58
90	600873	梅花生物	1,407,589.00	2.58
91	002019	亿帆鑫富	1,402,475.00	2.57
92	000333	美的集团	1,382,024.00	2.53
93	300191	潜能恒信	1,377,159.35	2.52
94	600987	航民股份	1,356,533.00	2.48
95	002202	金风科技	1,355,899.80	2.48
96	002604	龙力生物	1,355,603.00	2.48
97	002241	歌尔股份	1,289,640.12	2.36

98	601996	丰林集团	1,264,737.44	2.32
99	000910	大亚科技	1,215,759.00	2.23
100	002750	龙津药业	1,170,961.00	2.14
101	600598	北大荒	1,134,464.00	2.08
102	300338	开元仪器	1,128,583.00	2.07
103	603699	纽威股份	1,121,084.44	2.05
104	300284	苏交科	1,118,250.00	2.05
105	001979	招商蛇口	1,117,803.00	2.05
106	600828	茂业商业	1,114,500.00	2.04

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002303	美盈森	9,683,208.56	17.73
2	002701	奥瑞金	8,331,942.10	15.26
3	002032	苏泊尔	6,763,380.72	12.38
4	600887	伊利股份	6,596,754.67	12.08
5	600298	安琪酵母	6,577,144.63	12.04
6	002271	东方雨虹	5,848,875.16	10.71
7	002458	益生股份	5,548,022.55	10.16
8	600626	申达股份	5,547,470.85	10.16
9	600104	上汽集团	5,118,233.61	9.37
10	002234	民和股份	4,941,138.00	9.05
11	600900	长江电力	4,396,320.14	8.05
12	300160	秀强股份	4,387,507.63	8.03
13	600697	欧亚集团	4,278,038.71	7.83
14	000888	峨眉山 A	4,276,220.22	7.83
15	600963	岳阳林纸	4,201,104.89	7.69
16	300146	汤臣倍健	4,144,904.62	7.59
17	000158	常山股份	4,098,632.02	7.50
18	000429	粤高速 A	4,068,410.97	7.45
19	002563	森马服饰	3,973,451.27	7.28
20	600519	贵州茅台	3,972,752.87	7.27
21	600801	华新水泥	3,958,247.26	7.25
22	600409	三友化工	3,952,320.33	7.24
23	002394	联发股份	3,886,602.65	7.12

24	300351	永贵电器	3,732,738.38	6.83
25	600138	中青旅	3,543,804.72	6.49
26	002714	牧原股份	3,305,029.60	6.05
27	600054	黄山旅游	3,138,361.00	5.75
28	600694	大商股份	3,135,373.44	5.74
29	600446	金证股份	3,094,808.72	5.67
30	002043	兔宝宝	3,034,564.06	5.56
31	002385	大北农	3,024,710.00	5.54
32	000039	中集集团	3,016,619.30	5.52
33	002229	鸿博股份	2,996,805.66	5.49
34	002302	西部建设	2,945,976.24	5.39
35	600612	老凤祥	2,882,125.63	5.28
36	600168	武汉控股	2,875,106.74	5.26
37	002678	珠江钢琴	2,739,659.08	5.02
38	601766	中国中车	2,674,880.64	4.90
39	601607	上海医药	2,653,666.58	4.86
40	603609	禾丰牧业	2,569,920.00	4.71
41	600036	招商银行	2,545,032.33	4.66
42	600535	天士力	2,512,864.19	4.60
43	002050	三花股份	2,413,742.52	4.42
44	600978	宜华生活	2,383,599.61	4.36
45	601169	北京银行	2,329,211.00	4.26
46	000069	华侨城 A	2,328,667.00	4.26
47	601339	百隆东方	2,327,052.42	4.26
48	300144	宋城演艺	2,326,453.70	4.26
49	600276	恒瑞医药	2,234,392.68	4.09
50	000651	格力电器	2,182,943.82	4.00
51	000925	众合科技	2,099,891.59	3.84
52	300011	鼎汉技术	2,095,286.84	3.84
53	002677	浙江美大	2,090,774.17	3.83
54	002646	青青稞酒	2,027,818.15	3.71
55	601688	华泰证券	2,002,400.00	3.67
56	600674	川投能源	1,930,915.00	3.54
57	600498	烽火通信	1,867,698.20	3.42
58	002480	新筑股份	1,847,261.65	3.38
59	600585	海螺水泥	1,841,111.06	3.37
60	002507	涪陵榨菜	1,830,703.25	3.35
61	300094	国联水产	1,821,398.40	3.33

62	002404	嘉欣丝绸	1,789,640.92	3.28
63	300203	聚光科技	1,764,482.64	3.23
64	603818	曲美家居	1,763,430.14	3.23
65	300164	通源石油	1,760,762.84	3.22
66	300342	天银机电	1,741,500.00	3.19
67	000921	海信科龙	1,724,096.00	3.16
68	603611	诺力股份	1,686,678.00	3.09
69	600336	澳柯玛	1,655,324.00	3.03
70	600289	亿阳信通	1,599,074.96	2.93
71	002308	威创股份	1,585,651.00	2.90
72	002078	太阳纸业	1,584,326.40	2.90
73	603000	人民网	1,582,025.72	2.90
74	000818	方大化工	1,571,474.72	2.88
75	601633	长城汽车	1,571,104.68	2.88
76	000998	隆平高科	1,519,973.30	2.78
77	601998	中信银行	1,494,457.02	2.74
78	600816	安信信托	1,483,885.00	2.72
79	600873	梅花生物	1,477,800.00	2.71
80	300346	南大光电	1,460,751.05	2.67
81	002604	龙力生物	1,441,560.00	2.64
82	601800	中国交建	1,417,396.00	2.60
83	300191	潜能恒信	1,378,284.00	2.52
84	600987	航民股份	1,362,649.23	2.49
85	300059	东方财富	1,358,640.00	2.49
86	002202	金风科技	1,356,047.10	2.48
87	002019	亿帆鑫富	1,340,552.00	2.45
88	000910	大亚科技	1,279,135.00	2.34
89	002241	歌尔股份	1,239,751.00	2.27
90	300284	苏交科	1,222,832.00	2.24
91	001979	招商蛇口	1,176,024.00	2.15
92	601996	丰林集团	1,153,312.40	2.11
93	300338	开元仪器	1,149,150.00	2.10
94	002640	跨境通	1,123,637.60	2.06
95	002750	龙津药业	1,121,452.00	2.05

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	299,752,957.60
卖出股票收入（成交）总额	276,224,520.47

### 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	67,644.62
2	应收证券清算款	570,624.09
3	应收股利	-
4	应收利息	6,317.44
5	应收申购款	2,472.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	647,058.87

#### 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

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
950	55,390.43	0.00	0.00%	52,620,911.82	100.00%

#### 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	2,409.96	0.0046%

#### 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年5月27日)基金份额总额	315,950,659.67
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	9,377,538.17
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	272,707,286.02
本报告期末基金份额总额	52,620,911.82

## § 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), 该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今, 本年度应支付的审计费用为 50,000.00 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	
安信证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	6,637,065.24	1.15%	6,048.38	1.14%	-
第一创业	1	-	-	-	-	-

东北证券	1	11,228,011.01	1.95%	10,231.89	1.93%	-
东方证券	1	11,736,625.51	2.04%	10,930.47	2.06%	-
东吴证券	1	14,404,141.05	2.50%	13,414.65	2.53%	-
方正证券	1	67,631,839.13	11.74%	61,632.74	11.64%	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	88,853,525.73	15.43%	82,748.63	15.63%	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	33,605,406.52	5.83%	30,624.76	5.78%	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	80,246,758.63	13.93%	74,211.00	14.01%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	4,209,064.60	0.73%	3,835.69	0.72%	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
申万宏源西部	1	-	-	-	-	-
天风证券	3	60,404,331.48	10.49%	55,047.87	10.40%	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	35,544,080.80	6.17%	33,102.01	6.25%	-
中金公司	2	27,819,568.60	4.83%	25,908.39	4.89%	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	106,611,628.59	18.51%	97,156.88	18.35%	-
中信证券	1	27,014,829.13	4.69%	24,618.75	4.65%	-
中银国际	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

本报告期交易单元均为本报告期新增，无其他变更。

## 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

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
安信证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	20,000,000.	100.00%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
申万宏源西部	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

融通基金管理有限公司

二〇一七年三月三十日