

融通转型三动力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 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三动力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 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	融通转型三动力灵活配置混合
基金主代码	000717
前端交易代码	000717
后端交易代码	000718
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 1 月 16 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	100,902,231.77 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要挖掘经济转型过程中高端装备制造业、医疗保健行业、信息产业等三个行业发展带来的投资机会，在合理控制投资风险的基础上，获取基金资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的长期收益。
投资策略	本基金采用“自下而上，个股优选”的投资策略，挖掘经济转型带来的投资机会，重点投资高端装备制造业、医疗保健行业、信息产业三大行业的股票，构建在中长期能够从转型中受益的投资组合。

业绩比较基准	50%×沪深 300 指数收益率+50%×中债综合（全价）指数收益率
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与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高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

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 1 月 16 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-14,424,527.66	93,746,283.19
本期利润	-26,326,108.99	106,028,425.90
加权平均基金份额本期利润	-0.2415	0.4024
本期基金份额净值增长率	-17.26%	35.00%
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	0.1165	0.2900
期末基金资产净值	112,657,497.62	153,384,807.81
期末基金份额净值	1.117	1.350

注：1、本基金合同生效日为 2015 年 1 月 16 日，截止报告期末本基金合同生效未满一年，相关数据根据实际存续期计算；

2、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；

3、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；

4、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）。

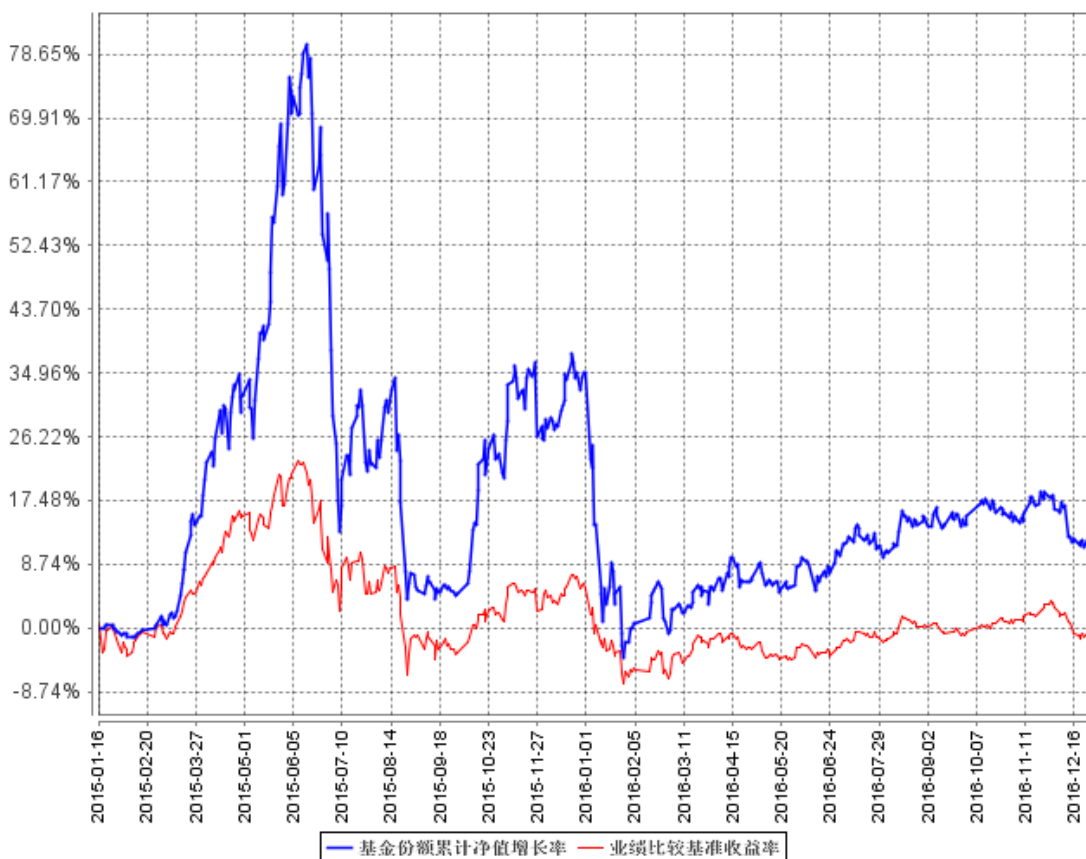
3.2 基金净值表现

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	-3.12%	0.78%	-0.27%	0.39%	-2.85%	0.39%
过去六个月	1.09%	0.80%	1.80%	0.39%	-0.71%	0.41%
过去一年	-17.26%	1.48%	-6.01%	0.70%	-11.25%	0.78%
自基金合同生效起至今	11.70%	1.92%	-0.79%	1.01%	12.49%	0.91%

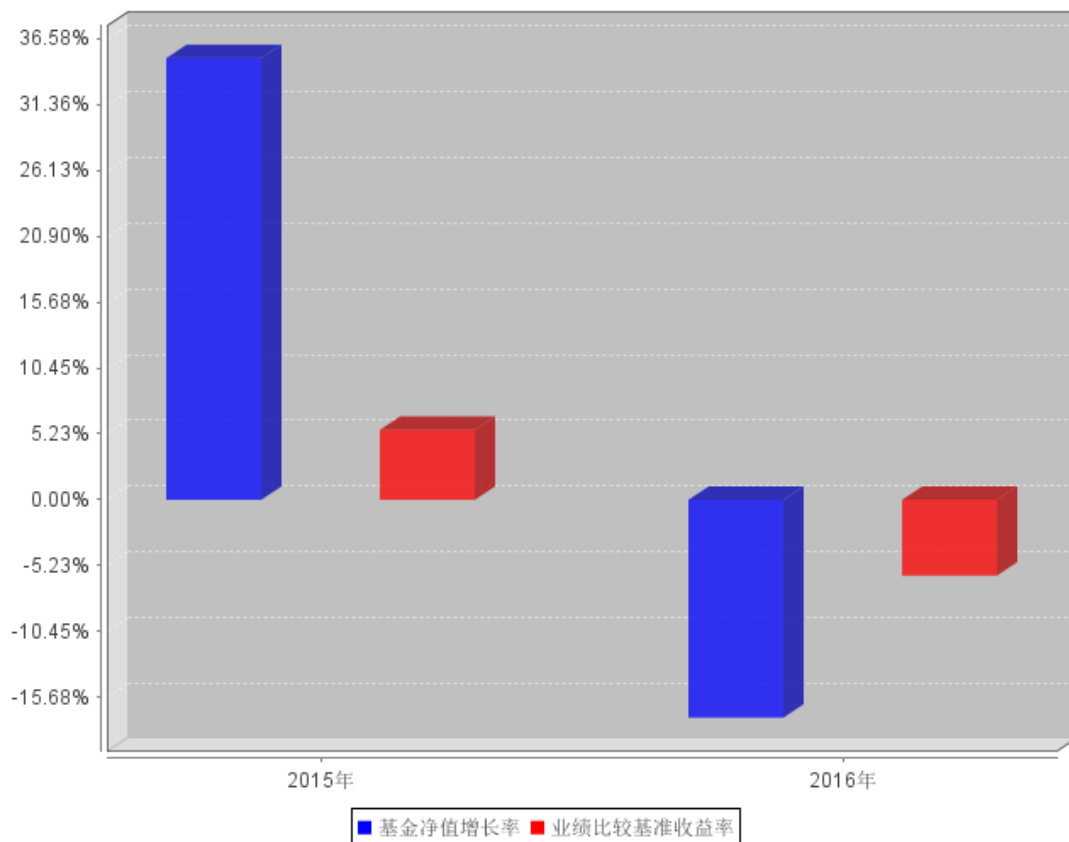
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 2015 年 1 月 16 日，2015 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

本基金合同生效日以来没有实施利润分配。

§ 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		
张延闽	本基金的基金经理	2015/1/16	-	6	张延闽先生，哈尔滨工业大学工学硕士、工学学士，6 年证券投资从业经历，具有基金从业资格。2010 年 2 月加入融通基金管理有限公司，现任融通通乾研究精选灵活配置混合（由原通乾证券投资基金转型而来）、融通转型三动力灵活配置混合基金的基金经理。

注：任免日期均指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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 年年初，本基金经历“熔断”导致净值跌幅较大，下半年调整持仓思路，增加了稳健类股票的配置比重，情况有所好转。纵观全年，组合负收益主要来自年初的仓位选择错过反弹和年底成长股的欠佳表现。

本基金采用“自下而上，精选个股”的投资策略。倾向于挑选有特色的个股，关注如业务稀缺性、行业地位、盈利可持续性等方面。现有持仓结构主要分布在零售、金融、医药、环保、机械制造等行业。

2017 年本基金会吸取过去的经验教训，通过组合配置分散风险，提高个股超额收益率，力争在未来创造好的收益。

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-17.26%，同期业绩比较基准收益率为-6.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2008 年以来，全球超宽松的货币政策并没有带来经济的健康增长，反而让各国陷入过度负债的困境。究其原因，在推动经济增长的长期要素中，由于一直缺乏颠覆性技术出现，单独依赖资本的力量已经达到瓶颈。各国政府也意识到继续超发货币只可能导致更严重的地产、股票和商品泡沫，并且无助于改善债务积压。美联储最近一次加息也代表了反思后的货币政策取向：从超宽松走向适度宽松。但是冰冻三尺非一日之寒，经济增长依赖印钞机已经成瘾，短期甚至已经成为一个无解的经济学难题。因此我们不认为低利率环境会发生趋势性的逆转，而更多的是阶段性的修补。无论是“超宽松”还是“适度宽松”，其主基调仍然是“宽松”。

基于中期流动性维持宽松的假设，我们认为 2017 年股票市场投资机会将显著多于 2016 年。首先，股市去杠杆已经经历一年半时间，而期货、楼市和债市的去杠杆才刚刚开始。在大类资产对比中，股票市场的杠杆率和估值都是相对低的，因此流动性最终会有利于二级市场表现。其次，中小创的估值泡沫是整体性的而非个股性的。我们观察到在某些前景明确的细分行业，虽然概念板块的累计市值惊人，但单个行业龙头的中长期市值并不高。需要选股者对公司和行业变化有精准的预判，并将最后胜出的公司挑选出来。IPO 大量供给会加速估值下移的节奏，小股票螺旋式下跌已经让投资者意识到批量买板块是一种糟糕的投资策略。我们认为公司之间经营的差距会打破现有市值平均分布曲线。业绩持续增长是今年的主旋律，现在比任何一个时候都要考验选股者中长期判断资产的能力，未来一段时间会是基本面分析者的春天。

2017 年可能的风险来自于内外两方面：对内去资产泡沫和经济短期增长的之间的矛盾，外部去全球化和民粹主义抬头带来的不确定性。然而计划常常赶不上变化，面对风险只能努力应对而无法预测。我们对于中国经济的中长期前景持乐观态度。大国的优势在于经济政策的施展空间和容错能力更高。并且中国现阶段整体劳动力的比较优势非常明显，国内制造业仍然在全球维持很强的竞争力。考虑到潜在的改革红利，未来生产效率有很大的提升空间。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，发现个别监督指标受市场影响被动超出监督比例，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 21176 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：融通转型三动力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	14,786,665.71	13,614,897.32
结算备付金	254,736.27	1,790,898.72
存出保证金	52,408.65	334,407.33
交易性金融资产	100,144,594.24	145,240,010.23
其中：股票投资	100,144,594.24	145,240,010.23
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	2,854.84	3,566.17
应收股利	-	-
应收申购款	357.86	258,710.49
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	115,241,617.57	161,242,490.26
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	2,116,454.70	6,146,726.14
应付赎回款	81,600.09	620,521.10
应付管理人报酬	146,341.87	193,201.38
应付托管费	24,390.29	32,200.25
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	155,187.39	802,813.22
应交税费	-	-
应付利息	-	-

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	60,145.61	62,220.36
负债合计	2,584,119.95	7,857,682.45
所有者权益：		
实收基金	100,902,231.77	113,620,740.54
未分配利润	11,755,265.85	39,764,067.27
所有者权益合计	112,657,497.62	153,384,807.81
负债和所有者权益总计	115,241,617.57	161,242,490.26

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.117 元，基金份额总额 100,902,231.77 份。

7.2 利润表

会计主体：融通转型三动力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 1 月 16 日(基金合 同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	-21,879,466.78	117,274,028.83
1. 利息收入	224,374.09	2,776,041.38
其中：存款利息收入	212,778.93	2,720,701.98
债券利息收入	-	14,145.06
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	11,595.16	41,194.34
其他利息收入	-	-
2. 投资收益	-10,249,861.18	98,037,424.58
其中：股票投资收益	-10,854,473.03	96,301,408.27
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-15,000.00
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	604,611.85	1,751,016.31
3. 公允价值变动收益	-11,901,581.33	12,282,142.71
4. 汇兑收益	-	-
5. 其他收入	47,601.64	4,178,420.16
减：二、费用	4,446,642.21	11,245,602.93
1. 管理人报酬	1,803,206.82	4,465,053.91
2. 托管费	300,534.46	744,175.63

3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,155,599.85	5,647,591.44
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	187,301.08	388,781.95
三、利润总额	-26,326,108.99	106,028,425.90
减：所得税费用	-	-
四、净利润	-26,326,108.99	106,028,425.90

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通转型三动力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)	113,620,740.54	39,764,067.27	153,384,807.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-26,326,108.99	-26,326,108.99
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-12,718,508.77	-1,682,692.43	-14,401,201.20
其中：1. 基金申购款	10,893,464.63	871,251.77	11,764,716.40
2. 基金赎回款	-23,611,973.40	-2,553,944.20	-26,165,917.60
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)	100,902,231.77	11,755,265.85	112,657,497.62
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 16 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)	664,827,527.20	-	664,827,527.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	106,028,425.90	106,028,425.90
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-551,206,786.66	-66,264,358.63	-617,471,145.29
其中：1. 基金申购款	268,193,998.75	127,826,445.48	396,020,444.23
2. 基金赎回款	-819,400,785.41	-194,090,804.11	-1,013,491,589.52
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)	113,620,740.54	39,764,067.27	153,384,807.81

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：

<u>高峰</u>	<u>颜锡廉</u>	<u>刘美丽</u>
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（“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

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 16 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	-	-	14,600,049.36	0.39%

7.4.3.1.2 权证交易

本基金本报告期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。

7.4.3.1.3 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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月16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	13,292.17	0.39%	-	-

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。

7.4.3.2 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 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年1月16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	1,803,206.82
其中：支付销售机构的客户维护费	867,012.08	2,779,652.05

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1.50%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：日基金管理人报酬=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。

7.4.3.2.2 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16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	300,534.46

注：支付基金托管人中国建设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。

7.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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。

7.4.3.4 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

份额单位：份

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 16 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
基金合同生效日(2015 年 1 月 16 日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	4,067,567.44	-
期间申购/买入总份额	-	4,067,567.44
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	4,067,567.44	4,067,567.44
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.03%	3.58%

注：基金管理人融通基金管理有限公司在上年度可比期间申购本基金的交易通过融通基金管理有限公司网上直销汇款交易方式办理，适用费率为零。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2016 年 12 月 31 日		2015 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
新时代证券	1,638,972.22	1.62%	1,638,972.22	1.44%

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 16 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
中国建设银行	14,786,665.71	198,906.51	13,614,897.32	552,944.09

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。

7.4.3.6 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未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.3.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

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（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	-
601375	中原证券	2016-12-20	2017-1-3	新股未上市	4.00	4.00	15,799	63,196.00	63,196.00	-
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	-
603877	太平鸟	2016-12-29	2017-1-9	新股未上市	21.30	21.30	1,590	33,867.00	33,867.00	-
603266	天龙股份	2016-12-30	2017-1-10	新股未上市	14.63	14.63	1,172	17,146.36	17,146.36	-
300587	天铁股份	2016-12-28	2017-1-5	新股未上市	14.11	14.11	1,079	15,224.69	15,224.69	-
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-1-5	新股未上市	10.44	10.44	1,158	12,089.52	12,089.52	-
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	-
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。

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
002400	省广股份	2016-11-28	重大事项	12.79	-	-	230,505	3,347,793.70	2,948,158.95	-

注：本基金截至本期末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	100,144,594.24	86.90
	其中：股票	100,144,594.24	86.90
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	15,041,401.98	13.05
7	其他各项资产	55,621.35	0.05
8	合计	115,241,617.57	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	26,266,444.91	23.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,925.53	0.03
E	建筑业	15,592.23	0.01
F	批发和零售业	15,436,983.39	13.70
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	10,134,676.76	9.00
J	金融业	29,186,543.42	25.91
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,948,158.95	2.62

M	科学研究和技术服务业	10,980,561.90	9.75
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	5,137,707.15	4.56
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	100,144,594.24	88.89

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	300012	华测检测	950,698	10,980,561.90	9.75
2	601933	永辉超市	2,168,793	10,648,773.63	9.45
3	600016	民生银行	1,146,264	10,408,077.12	9.24
4	300145	中金环境	386,065	10,076,296.50	8.94
5	600085	同仁堂	298,639	9,371,291.82	8.32
6	600030	中信证券	538,100	8,641,886.00	7.67
7	300369	绿盟科技	196,650	6,680,200.50	5.93
8	600036	招商银行	300,048	5,280,844.80	4.69
9	300347	泰格医药	190,215	5,137,707.15	4.56
10	601607	上海医药	244,796	4,788,209.76	4.25

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	601398	工商银行	32,805,378.00	21.39
2	300012	华测检测	25,862,970.76	16.86
3	000776	广发证券	19,009,872.97	12.39
4	600276	恒瑞医药	18,782,672.47	12.25
5	600999	招商证券	16,487,085.62	10.75
6	601933	永辉超市	15,465,437.00	10.08
7	600570	恒生电子	15,430,243.53	10.06
8	300166	东方国信	14,350,121.36	9.36

9	600016	民生银行	13,706,244.92	8.94
10	002281	光迅科技	13,557,818.75	8.84
11	000783	长江证券	12,772,517.71	8.33
12	300190	维尔利	12,050,971.56	7.86
13	600085	同仁堂	11,224,427.98	7.32
14	601688	华泰证券	10,787,280.38	7.03
15	300058	蓝色光标	10,680,872.77	6.96
16	002074	国轩高科	10,600,618.13	6.91
17	600030	中信证券	10,551,554.00	6.88
18	300059	东方财富	10,279,859.00	6.70
19	601633	长城汽车	9,477,280.72	6.18
20	000550	江铃汽车	9,452,792.00	6.16
21	600362	江西铜业	9,367,407.00	6.11
22	300347	泰格医药	9,332,497.94	6.08
23	000759	中百集团	9,258,733.04	6.04
24	000039	中集集团	9,004,554.04	5.87
25	600547	山东黄金	8,179,370.14	5.33
26	000655	金岭矿业	8,103,985.59	5.28
27	300369	绿盟科技	8,069,006.95	5.26
28	300145	中金环境	8,032,686.93	5.24
29	601607	上海医药	7,724,507.00	5.04
30	600048	保利地产	7,240,510.16	4.72
31	603999	读者传媒	7,235,484.00	4.72
32	600199	金种子酒	7,088,044.00	4.62
33	300284	苏交科	7,083,933.44	4.62
34	600036	招商银行	6,406,477.29	4.18
35	002400	省广股份	6,166,189.32	4.02
36	601318	中国平安	6,004,688.98	3.91
37	601336	新华保险	6,004,516.56	3.91
38	601766	中国中车	5,955,753.97	3.88
39	600031	三一重工	5,914,827.98	3.86
40	600886	国投电力	5,896,030.00	3.84
41	002657	中科金财	5,856,879.34	3.82
42	000547	航天发展	5,843,129.80	3.81
43	300491	通合科技	5,799,006.83	3.78
44	000758	中色股份	5,766,717.78	3.76

45	600585	海螺水泥	5,737,477.00	3.74
46	002353	杰瑞股份	5,427,126.00	3.54
47	002343	慈文传媒	5,373,256.82	3.50
48	600562	国睿科技	5,181,925.80	3.38
49	002285	世联行	5,045,991.02	3.29
50	600815	厦工股份	4,895,231.19	3.19
51	601100	恒立液压	4,850,265.20	3.16
52	300310	宜通世纪	4,849,722.28	3.16
53	600000	浦发银行	4,661,485.53	3.04
54	002253	川大智胜	4,331,713.20	2.82
55	000028	国药一致	4,315,109.55	2.81
56	600489	中金黄金	3,687,530.76	2.40
57	000878	云南铜业	3,684,887.00	2.40
58	300015	爱尔眼科	3,682,000.00	2.40
59	000425	徐工机械	3,659,032.00	2.39
60	000157	中联重科	3,645,473.00	2.38
61	000528	柳 工	3,640,153.65	2.37
62	000933	*ST 神火	3,634,121.40	2.37
63	300242	明家联合	3,633,144.74	2.37
64	601021	春秋航空	3,623,318.76	2.36
65	601238	广汽集团	3,608,701.75	2.35
66	002673	西部证券	3,604,869.00	2.35
67	600958	东方证券	3,596,716.00	2.34
68	603019	中科曙光	3,595,635.00	2.34
69	002108	沧州明珠	3,589,098.02	2.34
70	600395	盘江股份	3,584,656.00	2.34
71	000983	西山煤电	3,583,755.40	2.34
72	002316	键桥通讯	3,580,863.23	2.33
73	002697	红旗连锁	3,566,530.54	2.33
74	300269	联建光电	3,542,312.00	2.31
75	300203	聚光科技	3,541,414.00	2.31
76	300182	捷成股份	3,537,032.00	2.31
77	600221	海南航空	3,523,145.00	2.30
78	000031	中粮地产	3,514,514.00	2.29
79	601009	南京银行	3,489,977.40	2.28
80	000625	长安汽车	3,489,304.00	2.27

81	002479	富春环保	3,436,098.00	2.24
82	603885	吉祥航空	3,335,634.00	2.17
83	002097	山河智能	3,201,162.00	2.09

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	601398	工商银行	28,089,475.76	18.31
2	600999	招商证券	20,756,811.57	13.53
3	000776	广发证券	18,670,425.72	12.17
4	600276	恒瑞医药	18,472,817.36	12.04
5	300012	华测检测	15,783,027.39	10.29
6	002281	光迅科技	15,177,790.32	9.90
7	600570	恒生电子	14,838,087.25	9.67
8	002253	川大智胜	14,474,057.56	9.44
9	300166	东方国信	14,371,440.06	9.37
10	000783	长江证券	13,169,152.23	8.59
11	600085	同仁堂	12,546,148.34	8.18
12	300190	维尔利	12,040,572.15	7.85
13	300145	中金环境	11,810,273.91	7.70
14	300142	沃森生物	11,417,125.56	7.44
15	601688	华泰证券	11,092,862.82	7.23
16	002074	国轩高科	10,935,028.08	7.13
17	300058	蓝色光标	10,282,303.94	6.70
18	600362	江西铜业	10,168,723.30	6.63
19	000759	中百集团	10,072,077.12	6.57
20	600030	中信证券	9,983,444.88	6.51
21	601933	永辉超市	9,820,755.91	6.40
22	000028	国药一致	9,696,738.21	6.32
23	601633	长城汽车	9,585,327.50	6.25
24	000550	江铃汽车	9,166,922.01	5.98
25	600562	国睿科技	8,861,564.60	5.78
26	002006	精功科技	8,802,534.37	5.74
27	000655	金岭矿业	8,552,996.47	5.58
28	002413	雷科防务	8,382,167.66	5.46
29	002316	键桥通讯	8,141,385.28	5.31
30	600547	山东黄金	7,897,834.12	5.15

31	300284	苏交科	7,785,499.50	5.08
32	600199	金种子酒	7,175,248.15	4.68
33	600048	保利地产	7,100,905.00	4.63
34	603999	读者传媒	6,882,538.69	4.49
35	000758	中色股份	6,452,925.07	4.21
36	601318	中国平安	6,107,143.92	3.98
37	600585	海螺水泥	6,057,588.56	3.95
38	601766	中国中车	5,948,680.22	3.88
39	000568	泸州老窖	5,895,496.74	3.84
40	601336	新华保险	5,801,659.00	3.78
41	600031	三一重工	5,749,845.88	3.75
42	600886	国投电力	5,656,696.94	3.69
43	300491	通合科技	5,649,978.00	3.68
44	601100	恒立液压	5,318,866.06	3.47
45	002353	杰瑞股份	5,248,794.00	3.42
46	300059	东方财富	5,080,988.32	3.31
47	002657	中科金财	4,973,599.77	3.24
48	300310	宜通世纪	4,787,402.20	3.12
49	002343	慈文传媒	4,692,434.50	3.06
50	600000	浦发银行	4,674,429.00	3.05
51	002285	世联行	4,659,570.64	3.04
52	600815	厦工股份	4,621,661.91	3.01
53	000039	中集集团	4,285,108.74	2.79
54	000547	航天发展	4,275,914.00	2.79
55	300347	泰格医药	4,193,132.73	2.73
56	600184	光电股份	4,151,654.00	2.71
57	002697	红旗连锁	4,123,439.60	2.69
58	002108	沧州明珠	4,082,060.67	2.66
59	601238	广汽集团	3,945,671.27	2.57
60	000933	*ST 神火	3,911,140.45	2.55
61	300269	联建光电	3,859,473.48	2.52
62	002673	西部证券	3,844,982.00	2.51
63	000425	徐工机械	3,830,313.83	2.50
64	603019	中科曙光	3,820,745.00	2.49
65	601021	春秋航空	3,807,768.25	2.48
66	300242	明家联合	3,795,048.99	2.47
67	000983	西山煤电	3,774,735.00	2.46
68	000528	柳 工	3,743,614.98	2.44

69	002479	富春环保	3,739,196.00	2.44
70	600395	盘江股份	3,712,962.00	2.42
71	300079	数码视讯	3,605,986.52	2.35
72	600958	东方证券	3,604,577.11	2.35
73	000157	中联重科	3,595,070.12	2.34
74	300015	爱尔眼科	3,568,049.86	2.33
75	600489	中金黄金	3,551,180.84	2.32
76	000625	长安汽车	3,510,025.26	2.29
77	601009	南京银行	3,500,131.00	2.28
78	600221	海南航空	3,467,696.00	2.26
79	300203	聚光科技	3,452,284.00	2.25
80	000878	云南铜业	3,425,222.00	2.23
81	603885	吉祥航空	3,415,760.00	2.23
82	002097	山河智能	3,364,956.91	2.19
83	300182	捷成股份	3,317,958.62	2.16
84	600016	民生银行	3,275,328.72	2.14
85	300006	莱美药业	3,091,773.43	2.02

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	700,147,404.32
卖出股票收入（成交）总额	722,486,765.95

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未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	52,408.65
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,854.84
5	应收申购款	357.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	55,621.35

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
3,571	28,256.02	5,706,539.66	5.66%	95,195,692.11	94.34%

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	649,250.50	0.6435%

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	50~100
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（2015年1月16日）基金份额总额	664,827,527.20
本报告期期初基金份额总额	113,620,740.54
本报告期基金总申购份额	10,893,464.63
减：本报告期基金总赎回份额	23,611,973.40
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	100,902,231.77

§ 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。

11.2.2 基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

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 60,000.00 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	
方正证券	1	203,253,947.80	14.31%	185,227.29	14.17%	-
中信建投	1	191,466,753.50	13.48%	174,484.38	13.35%	-
华创证券	2	184,281,041.56	12.97%	171,621.40	13.13%	-
广发证券	1	164,154,801.37	11.55%	152,876.98	11.70%	-
中金公司	2	145,237,060.60	10.22%	132,354.79	10.13%	-
长江证券	1	123,047,757.45	8.66%	112,134.49	8.58%	-
中信证券	1	90,986,537.22	6.40%	82,917.49	6.34%	-
东方证券	1	86,977,156.65	6.12%	81,002.11	6.20%	-

国泰君安	1	84,421,161.03	5.94%	78,503.13	6.01%	-
招商证券	1	63,564,108.88	4.47%	59,196.87	4.53%	-
平安证券	2	42,140,213.49	2.97%	38,671.69	2.96%	-
兴业证券	1	20,465,037.06	1.44%	19,059.15	1.46%	-
国信证券	1	7,029,538.40	0.49%	6,406.07	0.49%	-
银河证券	1	4,709,701.00	0.33%	4,386.22	0.34%	-
国金证券	1	4,250,396.08	0.30%	3,958.37	0.30%	-
华泰证券	1	3,552,244.00	0.25%	3,237.28	0.25%	-
恒泰证券	2	1,155,785.30	0.08%	1,053.28	0.08%	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	3	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-

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) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的

需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

(6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

2、选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的程序包括以下四个步骤：

- (1) 券商服务评价；
- (2) 拟定租用对象。由研究部根据以上评价结果拟定备选的券商；
- (3) 上报批准。研究部将拟定租用对象上报分管副总经理批准；
- (4) 签约。在获得批准后，按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

3、交易单元变更情况

本报告期内，本基金新增东北证券 1 个、华宝证券 1 个、华创证券 1 个、民生证券 1 个、光大证券 2 个、天风证券 2 个、西南证券 3 个交易单元。

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
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	239,100,000.00	100.00%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-

融通基金管理有限公司

二〇一七年三月三十日