

融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金（原通
乾证券投资基金转型）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

融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金是由“通乾证券投资基金”转型而成。2016年6月8日至2016年7月6日，“通乾证券投资基金”的管理人融通基金管理有限公司以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议审议并通过了《关于通乾证券投资基金转型有关事项的议案》，内容包括通乾证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、范围和策略以及修订《通乾证券投资基金基金合同》等。本次持有人大会决议报中国证监会备案，并自表决通过之日2016年7月7日起生效。依据持有人大会决议，基金管理人向上海证券交易所申请“通乾证券投资基金”终止上市，“通乾证券投资基金”终止上市日为2016年8月12日。自“通乾证券投资基金”终止上市之日起，原《通乾证券投资基金基金合同》终止，由《通乾证券投资基金基金合同》修订而成的《融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》正式生效。“通乾证券投资基金”正式转型为开放式基金，存续期限调整为不定期，基金投资目标、范围和策略予以调整，同时更名为“融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金”，基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利义务关系以《融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》为准。

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通乾研究精选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20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告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)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告编制期间说明：

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。原通乾证券投资基金的报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 8 月 11 日止，融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金报告期自 2016 年 8 月 12 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	融通通乾研究精选灵活配置混合
基金主代码	002989
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 8 月 12 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	899,304,867.86 份
基金合同存续期	不定期

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	融通通乾封闭
场内简称	基金通乾
基金主代码	500038
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2001 年 8 月 29 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	2,000,000,000.00 份
基金合同存续期	2001 年 8 月 29 日至 2016 年 8 月 11 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2001 年 9 月 21 日

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，通过对行业发展趋势、企业的基本面、经营状况进行深入研究，精选出质地优秀、成长性良好的公司进行投资，寻求基金资产的长期稳健增值，力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。
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、货币市场工具及其他金融工具的比例，规避系统性风险。
业绩比较基准	沪深 300 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。

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金属于价值成长型基金，主要投资于具有一定竞争优势、业绩能够持续增长或具有增长潜力的成长型上市公司股票，同时兼顾价值型公司股票。通过组合投资，在有效分散和控制风险的前提下，谋求基金资产的稳定增长。
投资策略	以价值成长型投资为主导，把企业的内在价值和未来成长能力作为选择投资对象的最核心标准。重视对趋势的把握，顺势而为，灵活操作。

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

转型后

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016年8月12日(基金合同生效日)至2016年12月31日
本期已实现收益	58,399,477.09
本期利润	-4,261,205.16
加权平均基金份额本期利润	-0.0031
本期基金份额净值增长率	-1.11%
3.1.2 期末数据和指标	2016年12月31日
期末可供分配基金份额利润	-0.0548
期末基金资产净值	884,283,991.86
期末基金份额净值	0.9833

转型前

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016年1月1日至 2016年8月11日	2015年	2014年
本期已实现收益	-312,598,864.37	1,206,927,287.11	418,150,644.78
本期利润	-331,943,416.77	490,852,041.05	1,053,995,582.45
加权平均基金份额本期利润	-0.1660	0.2454	0.5270

本期基金份额净值增长率	-8.15%	18.01%	47.59%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年 8 月 11 日	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0954	0.6149	0.2114
期末基金资产净值	1,918,192,514.64	3,358,135,929.83	3,267,283,888.78
期末基金份额净值	0.9591	1.6791	1.6336

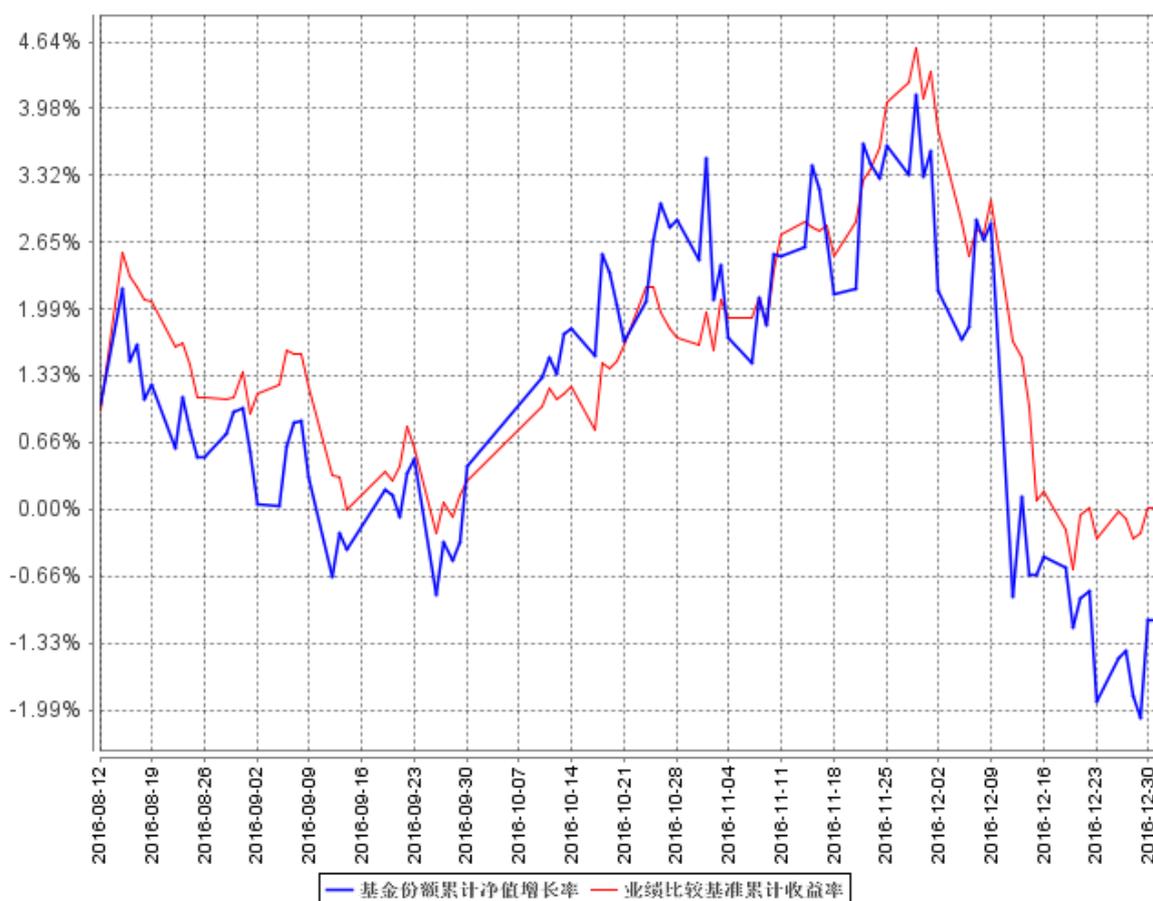
3.2 基金净值表现（转型后）

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	-1.52%	0.74%	-0.27%	0.39%	-1.25%	0.35%
自基金合同生效起至今	-1.11%	0.67%	0.01%	0.40%	-1.12%	0.27%

3.2.2 自基金转型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

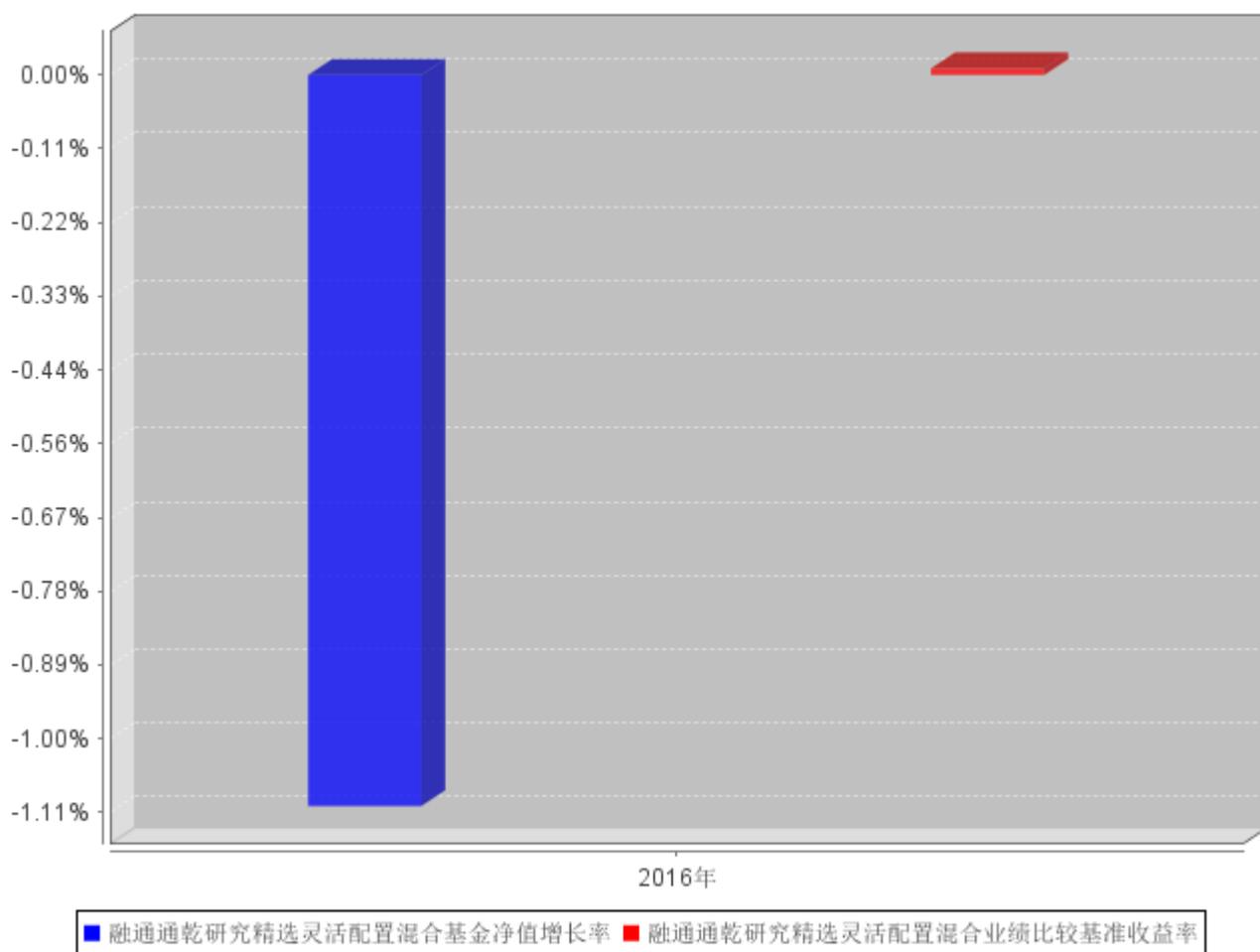
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金由通乾证券投资基金转型而来，转型生效日为 2016 年 8 月 12 日。

3.2.3 自基金转型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

融通通乾研究精选灵活配置混合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



3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.4 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

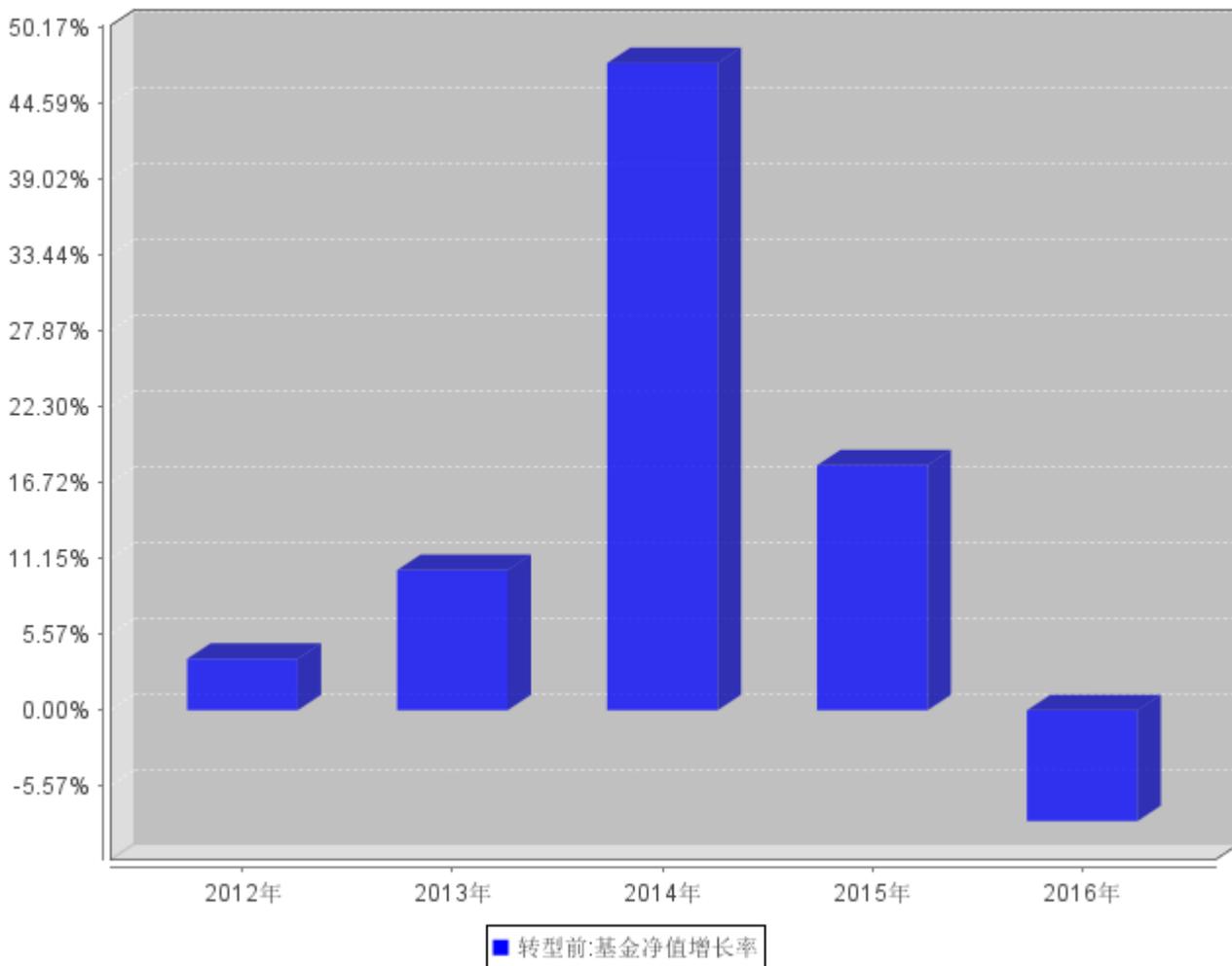
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	① ③	② ④
2016-7-1 至 2016-8-11	3.31%	1.69%	-	-	-	-
2016-1-1 至 2016-8-11	-8.15%	2.30%	-	-	-	-
2014-1-1 至 2016-8-11	59.98%	3.48%	-	-	-	-
2012-1-1 至 2016-8-11	83.15%	3.05%	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	535.46%	2.88%	-	-	-	-

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



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



3.4 过去三年基金的利润分配情况

转型后

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	-	-	-	-	

转型前

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	5.5400	1,107,999,998.42	-	1,107,999,998.42	
2015	2.0000	400,000,000.00	-	400,000,000.00	
2014	0.2500	50,000,003.44	-	50,000,003.44	

合计	7.7900	1,558,000,001.86	-	1,558,000,001.86	
----	--------	------------------	---	------------------	--

§ 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（转型后）

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	2016年8月12日	-	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，2014年10月25日起至今

					任“融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金（由原通乾证券投资基金转型而来）”基金经理，2015年1月16日起至今任“融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金”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、本基金由“通乾证券投资基金”转型而来，转型日期为2016年8月12日，转型前后基金经理均为张延闽，其任“通乾证券投资基金”基金经理的任职期间为2014年10月25日起至2016年8月12日止期间。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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	2014年10月25日	-	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，2014年10月25日起至今任“融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金（由原通乾证券投资基金转型而来）”基金经理，2015年1月16日起至今任“融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金”基金经理。
郭鹏	本基金的基金经理	2015年1月6日	2016年5月14日	9	郭鹏先生，南开大学经济学硕士、山东大学工学学士，9年证券投资从业经历，具有基金从业资格。历任渤海证券公司研究员、新华资产权益投资部研究员、宏源证券北京资产分公司投资经理、齐鲁证券北京证券资产分公司执行总经理。2014年10月加入融通基金管理有限公司，2015年1月6日起2016年5月14日任“通乾证券投资基金”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

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.4.3 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年 8 月，本基金从“基金通乾”转型而来，顺利实现了“封转开”，并平稳应对了客户赎回的冲击。回顾全年的投资过程，在转型之前始终保持中低仓位，并将有限的仓位集中于白酒医药等消费品板块。转型之后，增加了金融和成长股的配置，提高了股票仓位并使组合结构更加均衡。纵观全年，年初的低仓位降低了净值回撤幅度，虽然年底券商和成长股表现欠佳，但底仓配置的白酒板块缓冲了部分净值下跌。

本基金立足于长期投资，坚持“自下而上，逆向选股”策略。我们坚信“股价的长期增值来源于企业持续的价值创造”。在目前的宏观环境下，持续创造自由现金流的能力是我们评判行业和公司的重要依据。本基金目前重仓于券商、零售、医药、白酒等行业。它们的共同特点是拥有良好的可预期的现金流和盈利能力。在此基础上，我们青睐于细分行业的龙头。过往商品短缺的年代，公司成长的逻辑是低渗透率下的野蛮生长。随着低层次需求饱和，从无到有之后将是新一

轮竞争格局的洗牌。一方面在资本是主要生产要素的传统领域，融资成本两极分化非常不利于中小企业发展。另一方面，社会需求发生了重要变化，消费者即看中高性价比又追逐品牌，核心品牌影响力呈现强者恒强。

本基金规避风险的手段是个股长期价值判断和组合管理。首先必须避免的致命风险是对产业趋势的误判，其次个股的高估值会抑制其长期潜在回报。最后，由于市场存在无法平抑系统性波动，适当的组合管理是必要的。我们在组合构建的时候会突出重点，有所为有所不为。希望通过组合配置分散风险，在个股选择取得超额收益，提高组合风险收益比。

感谢持有人的长期信任，2017 年我们如履薄冰，努力为大家创造好的收益。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

转型后（2016 年 8 月 12 日-2016 年 12 月 31 日）：

本报告期基金份额净值增长率为-1.11%，同期业绩比较基准收益率为 0.01%。

转型前（2016 年 1 月 1 日-2016 年 8 月 11 日）：

本报告期基金份额净值增长率为-8.15 %。

4.6 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，经济增张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。

4.7 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应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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

转型后：（2016 年 8 月 12 日-2016 年 12 月 31 日）：

本基金本报告期内未进行利润分配，符合法律法规和基金合同的规定。

转型前：（2016 年 1 月 1 日-2016 年 8 月 11 日）

本基金管理人于 2016 年 4 月 22 日实施利润分配，以 2015 年 12 月 31 日的可分配收益为基准，每 10 份基金份额派发现金红利 5.54 元。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，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，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，转型后（2016 年 8 月 12 日-2016 年 12 月 31 日）的基金未进行利润分配，转型前（2016 年 1 月 1 日-2016 年 8 月 11 日）的基金实施利润分配的金额为 1,107,999,998.42 元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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

转型后

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 21199 号），投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

转型前

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 21184 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（转型后）

7.1 资产负债表（转型后）

会计主体：融通通乾研究精选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
资产：	
银行存款	62,872,594.84
结算备付金	2,055,236.57
存出保证金	305,557.02
交易性金融资产	843,375,397.53
其中：股票投资	803,331,397.53
基金投资	-
债券投资	40,044,000.00
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	1,817,493.97
应收利息	2,209,336.53
应收股利	-
应收申购款	374.46
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	912,635,990.92
	本期末 2016 年 12 月 31 日
负债和所有者权益	
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	-
应付赎回款	22,765,833.89
应付管理人报酬	1,275,488.16
应付托管费	212,581.37
应付销售服务费	-
应付交易费用	1,060,255.87
应交税费	1,830,675.94
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	1,207,163.83
负债合计	28,351,999.06
所有者权益：	
实收基金	932,279,972.99

未分配利润	-47,995,981.13
所有者权益合计	884,283,991.86
负债和所有者权益总计	912,635,990.92

注:1. 报告截止日 2016 年 12 月 31 日,基金份额净值 0.9833 元,基金份额总额 899,304,867.86 份。

2. 本基金由通乾证券投资基金转型而来,基金合同生效日为 2016 年 8 月 12 日,2016 年度实际报告期间为 2016 年 8 月 12 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日。截止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:融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2016 年 8 月 12 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 8 月 12 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	8,311,109.17
1. 利息收入	4,076,048.69
其中:存款利息收入	349,241.58
债券利息收入	3,657,689.65
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	69,117.46
其他利息收入	-
2. 投资收益	63,236,340.02
其中:股票投资收益	52,937,284.54
基金投资收益	-
债券投资收益	7,472,152.00
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	2,826,903.48
3. 公允价值变动收益	-62,660,682.25
4. 汇兑收益	-
5. 其他收入	3,659,402.71
减: 二、费用	12,572,314.33
1. 管理人报酬	8,066,495.27
2. 托管费	1,344,415.89
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	2,471,908.05
5. 利息支出	-

其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	689,495.12
三、利润总额	-4,261,205.16
减：所得税费用	-
四、净利润	-4,261,205.16

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 8 月 12 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 8 月 12 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）	2,000,000,000.00	-81,807,485.36	1,918,192,514.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,261,205.16	-4,261,205.16
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,067,720,027.01	38,072,709.39	-1,029,647,317.62
其中：1. 基金申购款	32,772,719.91	-1,059,006.35	31,713,713.56
2. 基金赎回款	-1,100,492,746.92	39,131,715.74	-1,061,361,031.18
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）	932,279,972.99	-47,995,981.13	884,283,991.86

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、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

7.4.1.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.1.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.2 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
融通基金管理有限公司(“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

本基金本期无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年8月12日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期应支付的管理费	8,066,495.27
其中：支付销售机构的客户维护费	87,441.03

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。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年8月12日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期应支付的托管费	1,344,415.89

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：

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

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。

7.4.3.4 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 2016年8月12日(基金合同生效日)至 2016年12月31日
基金合同生效日持有的基金份额	25,976,001.00
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-919,406.22
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	25,056,594.78
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.79%

7.4.3.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末，基金管理人主要股东及其控制的机构未持有本基金份额。

7.4.3.5 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 2016年8月12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	62,872,594.84	331,295.07

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

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

2、本基金本期未买入管理人、托管人的主要股东（非控股）在承销期内承销的证券。

7.4.3.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	说明
601375	中原证券	16/12/20	17/01/03	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603228	景旺电子	16/12/28	17/01/06	新股流通受限	23.16	23.16	3,491	80,851.56	80,851.56	-
603877	太平鸟	16/12/29	17/01/09	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	16/12/29	17/01/06	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603689	皖天然气	16/12/30	17/01/10	新股流通受限	7.87	7.87	4,819	37,925.53	37,925.53	-
603035	常熟汽饰	16/12/27	17/01/05	新股流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龙股份	16/12/30	17/01/10	新股流通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
300587	天铁股份	16/12/28	17/01/05	新股流通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	16/12/29	17/01/10	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	16/12/28	17/01/06	新股流通受限	15.28	15.28	682	10,420.96	10,420.96	-
603186	华正新材	16/12/26	17/01/03	新股流通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	16/12/27	17/01/05	新股流通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联新材	16/12/26	17/01/04	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	16/12/30	17/01/10	新股流通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	16/12/27	17/01/05	新股流通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.4.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

§ 7 年度财务报表（转型前）

7.1 资产负债表（转型前）

会计主体：通乾证券投资基金

报告截止日：2016年8月11日

单位：人民币元

资产	本期末 2016年8月11日	上年度末 2015年12月31日
资产：		
银行存款	70,690,882.00	24,850,054.99
结算备付金	2,134,040.74	7,085,742.47
存出保证金	931,053.04	1,915,772.30
交易性金融资产	1,832,327,963.01	3,276,353,813.55
其中：股票投资	1,110,648,963.01	2,293,004,813.55
基金投资	-	-
债券投资	721,679,000.00	983,349,000.00
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	2,275,674.83	42,319,235.56
应收利息	13,976,351.86	23,399,535.54
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	422,527.48	-
资产总计	1,922,758,492.96	3,375,924,154.41
负债和所有者权益	本期末 2016年8月11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	-	5,386,800.54

应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	860,287.29	4,255,793.38
应付托管费	143,381.20	709,298.88
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	388,902.69	4,507,655.84
应交税费	1,830,675.94	1,830,675.94
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,342,731.20	1,098,000.00
负债合计	4,565,978.32	17,788,224.58
所有者权益：		
实收基金	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未分配利润	-81,807,485.36	1,358,135,929.83
所有者权益合计	1,918,192,514.64	3,358,135,929.83
负债和所有者权益总计	1,922,758,492.96	3,375,924,154.41

注：报告截止日 2016 年 8 月 11 日(基金转型日前日)，基金份额净值 0.9591 元，基金份额总额 2,000,000,000.00 份。

7.2 利润表

会计主体：通乾证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 8 月 11 日(基金转型日前日)

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 8 月 11 日(基金转型日前日)	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	-291,381,563.64	584,440,608.15
1. 利息收入	21,916,290.49	33,967,039.32
其中：存款利息收入	1,135,428.59	1,565,877.83
债券利息收入	20,565,474.21	32,275,241.75
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	215,387.69	125,919.74
其他利息收入	-	-
2. 投资收益	-293,953,301.73	1,266,548,814.89
其中：股票投资收益	-319,346,932.88	1,246,795,733.80
基金投资收益	-	-
债券投资收益	14,904,637.40	6,517,385.22
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	10,488,993.75	13,235,695.87
3. 公允价值变动收益	-19,344,552.40	-716,075,246.06

4. 汇兑收益	-	-
5. 其他收入	-	-
减：二、费用	40,561,853.13	93,588,567.10
1. 管理人报酬	22,057,794.13	49,604,501.49
2. 托管费	3,707,374.99	8,267,416.90
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	11,788,799.32	33,900,173.06
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	3,007,884.69	1,816,475.65
三、利润总额	-331,943,416.77	490,852,041.05
减：所得税费用	-	-
四、净利润	-331,943,416.77	490,852,041.05

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：通乾证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 8 月 11 日(基金转型日前日)

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 8 月 11 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）	2,000,000,000.00	1,358,135,929.83	3,358,135,929.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-331,943,416.77	-331,943,416.77
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-1,107,999,998.42	-1,107,999,998.42
五、期末所有者权益（基金净值）	2,000,000,000.00	-81,807,485.36	1,918,192,514.64
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）	2,000,000,000.00	1,267,283,888.78	3,267,283,888.78
二、本期经营活动产生的基	-	490,852,041.05	490,852,041.05

金净值变动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-400,000,000.00	-400,000,000.00
五、期末所有者权益（基金净值）	2,000,000,000.00	1,358,135,929.83	3,358,135,929.83

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。

7.4.1.3 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、基金发起人
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
新时代证券股份有限公司（“新时代证券”）	基金管理人股东
日兴资产管理有限公司	基金管理人股东
北京奇睿天使投资咨询有限公司（“奇睿天使”）	基金发起人
陕西省国际信托股份有限公司（“陕国投”）	基金发起人
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。

根据《通乾证券投资基金基金合同》的规定，基金发起人发起设立基金时认购的基金份额，

可在基金上市一年后，按各发起人持有份额 50%的比例上市流通。原基金发起人之一的河北证券已于 2007 年 7 月 24 日被石家庄市中级人民法院受理进入破产清算程序，根据破产管理人的申请，自 2011 年 9 月 8 日起河北证券所持有的发起人份额中 250 万份基金份额可上市流通。剩余 250 万份基金份额已于 2010 年 12 月 31 日通过公开拍卖方式转让给北京奇睿天使投资咨询有限公司并由其承接河北证券作为发起人的权利义务，基金过户相关手续已于 2011 年 1 月 26 日完成。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元发生交易。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 8 月 11 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	22,057,794.13	49,604,501.49
其中：支付销售机构的客户维护费 ¹	-	-

注：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 1.5%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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

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 8 月 11 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	3,707,374.99	8,267,416.90

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。

7.4.3.3 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。

7.4.3.4 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自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8月11日 (基金转型日前日)	2015年1月1日至 2015年12月31日
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	15,976,001.00	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	25,976,001.00	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份 额比例	1.30%	0.50%

注：基金管理人融通基金在本报告期申购本基金的交易费用按交易所公布的公允的基金交易费率计算并支付。

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8月11日 (基金转型日前日)		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
陕国投	2,500,000.00	0.125%	2,500,000.00	0.125%
奇睿天使	2,500,000.00	0.125%	2,500,000.00	0.125%

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8月11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
中国建设银行	70,690,882.00	1,039,516.76	24,850,054.99	1,401,048.71

注：本基金的银行存款由基金托管人 中国建设银行保管，按银行约定利率计息。

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

7.4.3.7 其他关联交易事项的说明

本基金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 8 月 11 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	说明
601997	贵阳银行	16/08/08	16/08/16	新股流通受限	8.49	8.49	32,334	274,515.66	274,515.66	-
600936	广西广电	16/08/05	16/08/12	新股流通受限	4.80	4.80	17,150	82,320.00	82,320.00	-
601595	上海电影	16/08/09	16/08/17	新股流通受限	10.19	10.19	4,500	45,855.00	45,855.00	-
603515	欧普照明	16/08/11	16/08/19	新股流通受限	14.94	14.94	2,845	42,504.30	42,504.30	-
300533	冰川网络	16/08/11	16/08/18	新股流通受限	37.02	37.02	1,111	41,129.22	41,129.22	-
603986	兆易创新	16/08/10	16/08/18	新股流通受限	23.26	23.26	1,133	26,353.58	26,353.58	-
300532	今天国际	16/08/09	16/08/18	新股流通受限	16.32	16.32	838	13,676.16	13,676.16	-
603159	上海亚虹	16/08/04	16/08/12	新股流通受限	6.88	6.88	1,438	9,893.44	9,893.44	-
002808	苏州恒久	16/08/05	16/08/12	新股流通受限	7.71	7.71	1,128	8,696.88	8,696.88	-

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股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末及上年度可比期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

§ 8 投资组合报告（转型后）

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	803,331,397.53	88.02
	其中：股票	803,331,397.53	88.02
2	固定收益投资	40,044,000.00	4.39
	其中：债券	40,044,000.00	4.39
	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	64,927,831.41	7.11
7	其他各项资产	4,332,761.98	0.47
8	合计	912,635,990.92	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	384,414,217.36	43.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,925.53	0.00
E	建筑业	15,592.23	0.00
F	批发和零售业	86,616,288.72	9.80
G	交通运输、仓储和邮政业	9,458.68	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	55,543,405.39	6.28
J	金融业	189,990,600.02	21.49
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	86,703,909.60	9.80
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	803,331,397.53	90.85

8.3.3 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	000858	五粮液	2,519,464	86,871,118.72	9.82
2	600016	民生银行	9,558,389	86,790,172.12	9.81
3	300012	华测检测	7,506,832	86,703,909.60	9.80
4	601933	永辉超市	17,640,792	86,616,288.72	9.80
5	300145	中金环境	3,064,927	79,994,594.70	9.05
6	600085	同仁堂	2,326,877	73,017,400.26	8.26
7	600030	中信证券	4,538,715	72,891,762.90	8.24
8	000568	泸州老窖	2,124,779	70,117,707.00	7.93
9	601398	工商银行	6,848,500	30,201,885.00	3.42
10	300369	绿盟科技	839,761	28,526,681.17	3.23

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。

8.2 报告期内股票投资组合的重大变动

8.2.1 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	600030	中信证券	108,804,310.84	12.30
2	300059	东方财富	87,799,796.37	9.93
3	300012	华测检测	67,858,287.22	7.67
4	300124	汇川技术	46,937,915.30	5.31
5	600085	同仁堂	46,275,589.16	5.23
6	300369	绿盟科技	40,932,124.07	4.63
7	601398	工商银行	31,017,735.00	3.51
8	600016	民生银行	26,774,216.48	3.03
9	300015	爱尔眼科	25,433,669.74	2.88
10	000039	中集集团	23,780,158.29	2.69
11	601688	华泰证券	23,531,212.25	2.66

12	000031	中粮地产	21,229,446.59	2.40
13	000860	顺鑫农业	19,612,153.01	2.22
14	000568	泸州老窖	16,134,449.92	1.82
15	601998	中信银行	11,898,457.00	1.35
16	300145	中金环境	8,401,076.00	0.95
17	600809	山西汾酒	5,447,653.67	0.62
18	601163	三角轮胎	291,346.07	0.03
19	600909	华安证券	256,169.24	0.03
20	603858	步长制药	244,195.60	0.03

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。

8.2.2 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	601933	永辉超市	115,089,354.63	13.01
2	000860	顺鑫农业	109,191,216.59	12.35
3	600016	民生银行	101,667,167.66	11.50
4	300145	中金环境	73,747,669.37	8.34
5	000858	五粮液	58,101,478.67	6.57
6	000028	国药一致	51,758,782.87	5.85
7	300124	汇川技术	50,515,258.29	5.71
8	300059	东方财富	47,944,844.56	5.42
9	000759	中百集团	41,027,867.54	4.64
10	000031	中粮地产	37,379,662.66	4.23
11	600030	中信证券	31,847,399.73	3.60
12	600085	同仁堂	31,042,699.51	3.51
13	000039	中集集团	25,929,847.64	2.93
14	300015	爱尔眼科	23,910,706.73	2.70
15	601688	华泰证券	21,330,962.72	2.41
16	000729	燕京啤酒	20,361,323.91	2.30
17	600809	山西汾酒	18,576,077.95	2.10
18	300012	华测检测	15,835,235.79	1.79
19	601998	中信银行	12,052,575.68	1.36
20	300119	瑞普生物	10,062,973.00	1.14

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。

8.2.3 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	615,723,780.65
卖出股票收入（成交）总额	922,369,200.42

注：表中“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均指成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

8.3 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,044,000.00	4.53
	其中：政策性金融债	40,044,000.00	4.53
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	40,044,000.00	4.53

8.4 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	140201	14 国开 01	400,000	40,044,000.00	4.53

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.8.1 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。

8.8.2 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。

8.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 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。

8.10 投资组合报告附注

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.10.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	305,557.02
2	应收证券清算款	1,817,493.97
3	应收股利	-
4	应收利息	2,209,336.53
5	应收申购款	374.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,332,761.98

8.10.4 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。

8.12.6 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。

§ 8 投资组合报告（转型前）

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	1,110,648,963.01	57.76
	其中：股票	1,110,648,963.01	57.76
2	固定收益投资	721,679,000.00	37.53
	其中：债券	721,679,000.00	37.53
	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	72,824,922.74	3.79
7	其他资产	17,605,607.21	0.92
8	合计	1,922,758,492.96	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	605,355,060.43	31.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	279,533,290.45	14.57
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	137,125.38	0.01
J	金融业	165,759,495.67	8.64
K	房地产业	20,100,000.00	1.05
L	租赁和商务服务业	45,287.32	0.00
M	科学研究和技术服务业	39,113,254.02	2.04
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	605,449.74	0.03

S	综合	-	-
	合计	1,110,648,963.01	57.90

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	601933	永辉超市	42,226,337	193,396,623.46	10.08
2	600016	民生银行	17,774,971	165,484,980.01	8.63
3	000858	五粮液	4,192,879	148,931,062.08	7.76
4	300145	中金环境	5,510,320	139,300,889.60	7.26
5	000860	顺鑫农业	5,436,361	122,046,304.45	6.36
6	000568	泸州老窖	1,754,129	56,518,036.38	2.95
7	600085	同仁堂	1,812,086	54,779,359.78	2.86
8	000028	国药一致	738,139	51,071,837.41	2.66
9	300012	华测检测	3,331,623	39,113,254.02	2.04
10	000729	燕京啤酒	5,162,839	38,411,522.16	2.00

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	占期初基金资产净值比例（%）
1	000860	顺鑫农业	261,392,643.27	7.78
2	000858	五粮液	214,601,428.32	6.39
3	601933	永辉超市	206,196,231.40	6.14
4	600016	民生银行	164,917,405.92	4.91
5	600030	中信证券	157,919,081.10	4.70
6	600547	山东黄金	128,657,352.00	3.83
7	000568	泸州老窖	121,956,357.66	3.63
8	600111	北方稀土	120,626,214.98	3.59
9	601668	中国建筑	118,673,182.98	3.53
10	600048	保利地产	103,763,871.95	3.09
11	600036	招商银行	90,769,055.27	2.70
12	601318	中国平安	89,440,349.75	2.66
13	002008	大族激光	89,195,012.92	2.66

14	000792	盐湖股份	86,455,734.42	2.57
15	600362	江西铜业	85,029,861.25	2.53
16	300145	中金环境	79,009,876.66	2.35
17	300203	聚光科技	69,976,264.66	2.08
18	300142	沃森生物	65,792,592.50	1.96
19	601021	春秋航空	65,100,383.66	1.94
20	600221	海南航空	63,681,313.24	1.90

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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002299	圣农发展	148,090,194.99	4.41
2	000860	顺鑫农业	146,772,344.51	4.37
3	600030	中信证券	138,555,886.68	4.13
4	600547	山东黄金	130,182,442.04	3.88
5	600111	北方稀土	117,018,061.00	3.48
6	002126	银轮股份	111,453,987.40	3.32
7	601668	中国建筑	111,012,673.62	3.31
8	000858	五粮液	103,878,608.29	3.09
9	600305	恒顺醋业	103,861,030.82	3.09
10	600362	江西铜业	95,874,256.41	2.85
11	600048	保利地产	93,663,637.13	2.79
12	000028	国药一致	92,503,817.63	2.75
13	600587	新华医疗	91,736,326.45	2.73
14	600036	招商银行	88,278,420.94	2.63
15	601318	中国平安	87,886,591.80	2.62
16	000792	盐湖股份	87,048,569.64	2.59
17	600756	浪潮软件	80,335,840.56	2.39
18	000568	泸州老窖	77,243,319.91	2.30
19	002008	大族激光	76,688,882.65	2.28
20	002234	民和股份	73,329,328.46	2.18
21	002224	三力士	71,267,974.54	2.12
22	600990	四创电子	69,553,116.29	2.07
23	000040	东旭蓝天	69,123,326.68	2.06
24	002746	仙坛股份	68,384,337.06	2.04

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	3,328,252,297.97
卖出股票收入（成交）总额	4,190,235,210.23

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	721,679,000.00	37.62
	其中：政策性金融债	721,679,000.00	37.62
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	721,679,000.00	37.62

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	160209	16 国开 09	1,700,000	170,017,000.00	8.86
2	140201	14 国开 01	1,000,000	101,400,000.00	5.29
3	150419	15 农发 19	1,000,000	100,010,000.00	5.21
4	160204	16 国开 04	1,000,000	100,010,000.00	5.21
5	160401	16 农发 01	700,000	70,063,000.00	3.65

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.1 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

8.12.2 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	931,053.04
2	应收证券清算款	2,275,674.83
3	应收股利	-
4	应收利息	13,976,351.86
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	422,527.48
8	其他	-
9	合计	17,605,607.21

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
5,220	172,280.63	467,355,399.56	51.97%	431,949,468.30	48.03%

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	29.82	0.00%

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	0

§ 10 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	2,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	31,667,589.53
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,061,573,825.85
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份 额减少以“-”填列）	-70,788,895.82
本报告期期末基金份额总额	899,304,867.86

§ 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

(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，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

本基金聘任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)，本年度应支付的审计费用为人民币 150,000.00 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（转型后）

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	
国信证券	2	460,453,523.32	30.01%	421,130.07	29.87%	-
中信证券	1	437,818,284.22	28.54%	407,740.78	28.92%	-
国泰君安	2	390,291,428.53	25.44%	355,679.46	25.22%	-
中金公司	1	154,986,585.48	10.10%	141,239.79	10.02%	-
海通证券	1	67,688,397.50	4.41%	63,037.56	4.47%	-
申万宏源	1	13,902,931.91	0.91%	12,947.72	0.92%	-
银河证券	1	9,096,300.37	0.59%	8,289.39	0.59%	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	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，本基金无交易单元变更。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	204,700,000.00	30.62%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	105,600,000.00	15.80%	-	-
申万宏源	-	-	358,200,000.00	53.58%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-

中银国际	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

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	2	1,951,067,414.26	25.96%	1,792,626.77	25.89%	-
申万宏源	1	1,823,602,632.26	24.27%	1,698,313.32	24.53%	-
中金公司	1	1,219,061,433.10	16.22%	1,110,939.55	16.05%	-
国信证券	2	1,080,746,283.99	14.38%	991,706.58	14.33%	-
银河证券	1	631,204,514.76	8.40%	575,225.85	8.31%	-
中银国际	1	452,936,350.10	6.03%	421,822.68	6.09%	-
海通证券	1	246,867,772.57	3.28%	229,910.99	3.32%	-
中信证券	1	109,850,098.28	1.46%	102,303.13	1.48%	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	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，本基金无交易单元变更。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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	-	-	-	-	-	-
申万宏源	174,417,866.00	100.00%	2,238,600,000.00	67.36%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	581,600,000.00	17.50%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	503,200,000.00	15.14%	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

融通基金管理有限公司

2017年3月30日