

融通通泰保本混合型证券投资基金  
2015 年年度报告摘要

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 30 日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据融通通泰保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同规定，于 2016 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告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。

本报告期自 2015 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	融通通泰保本	
基金主代码	000142	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 5 月 30 日	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,235,619,768.47 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	融通通泰保本混合 A	融通通泰保本混合 C
下属分级基金的交易代码:	000142	001124
报告期末下属分级基金的份额总额	117,932,513.37 份	2,117,687,255.10 份

注：自 2015 年 3 月 5 日，本基金实施份额分类并对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提申购费、赎回费和销售服务费。各类基金份额分别设置基金代码，并单独公布基金份额净

值。详情请参阅 2015 年 3 月 5 日在指定信息披露媒体上刊登的相关公告。

## 2.2 基金产品说明

投资目标	通过运用组合保险策略，在为符合保本条件的投资金额提供保本保障的基础上，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用时间不变性投资组合保险策略（TIPP, Time Invariant Portfolio Protection）和基于期权的组合保险策略（OBPI, Option-Based Portfolio Insurance）相结合的投资策略，通过量化技术动态调整资产配置比例，以达到保证本金安全的基本目标。
业绩比较基准	三年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金属保本混合型基金，在证券投资基金中属于低风险品种。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		融通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	涂卫东	洪渊
	联系电话	(0755) 26948666	(010) 66105799
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-883-8088、(0755) 26948088	95588
传真		(0755) 26935005	(010) 66105798

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<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	2015 年		2014 年	2013 年 5 月 30 日 (基金合同生效日)- 2013 年 12 月 31 日
	融通通泰保本混合 A	融通通泰保本混合 C	融通通泰保本混合	融通通泰保本混合
本期已实现收益	7,070,055.16	258,267,294.60	32,224,283.26	13,668,845.06
本期利润	9,863,870.28	260,668,326.99	53,399,348.61	918,160.41
加权平均基金份额本期利润	0.0650	0.0686	0.1516	0.0018
本期基金份额净值增长率	6.42%	6.57%	16.68%	0.10%

3.1.2 期末数据和指标	2015 年末		2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	0.1809	0.1712	0.1361	0.0013
期末基金资产净值	146,630,379.88	2,611,994,782.78	258,173,439.32	467,242,652.47
期末基金份额净值	1.243	1.233	1.168	1.001

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、自 2015 年 3 月 5 日，本基金实施基金份额分类。融通通泰保本混合 C 的数据统计期间为 2015 年 3 月 5 日至 2015 年 12 月 31 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

融通通泰保本混合 A

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	3.33%	0.17%	0.71%	0.01%	2.62%	0.16%
过去六个月	3.41%	0.16%	1.51%	0.01%	1.90%	0.15%
过去一年	6.42%	0.21%	3.37%	0.01%	3.05%	0.20%
自基金合同生效起至今	24.30%	0.18%	10.11%	0.01%	14.19%	0.17%

融通通泰保本混合 C

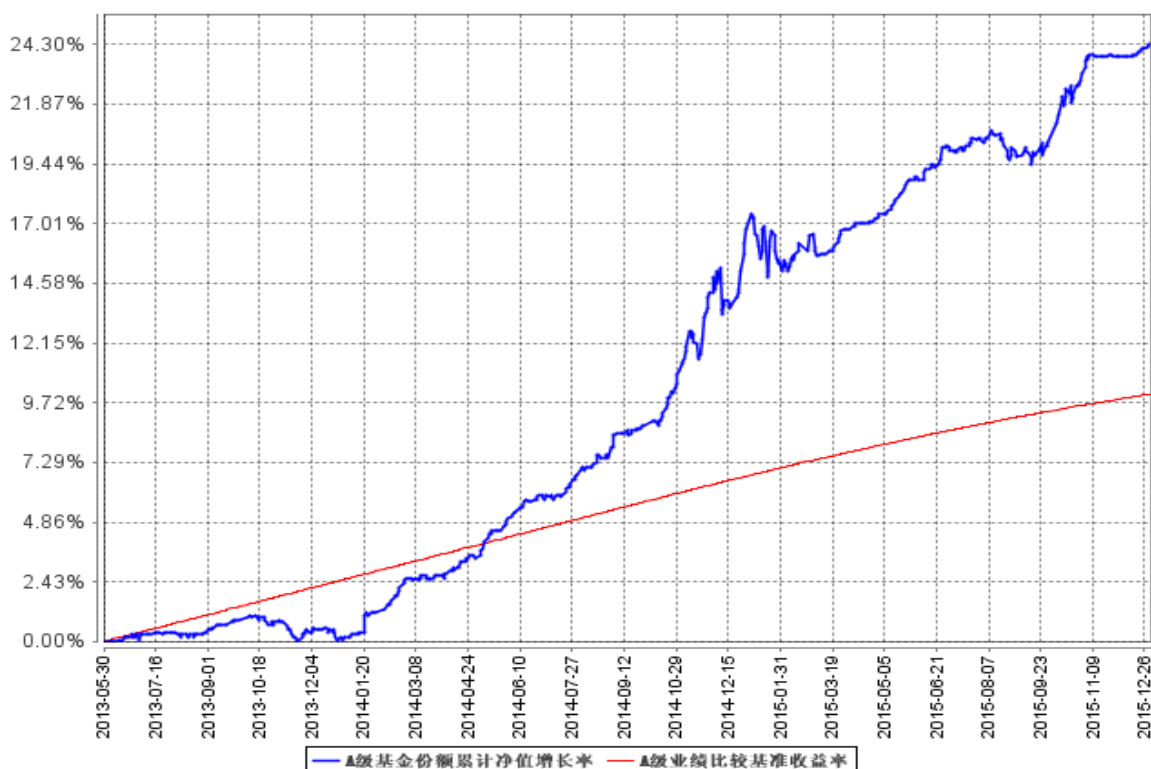
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.09%	0.16%	0.71%	0.01%	2.38%	0.15%

过去六个月	2.92%	0.12%	1.51%	0.01%	1.41%	0.11%
自基金合同生效起至今	6.57%	0.19%	2.68%	0.01%	3.89%	0.18%

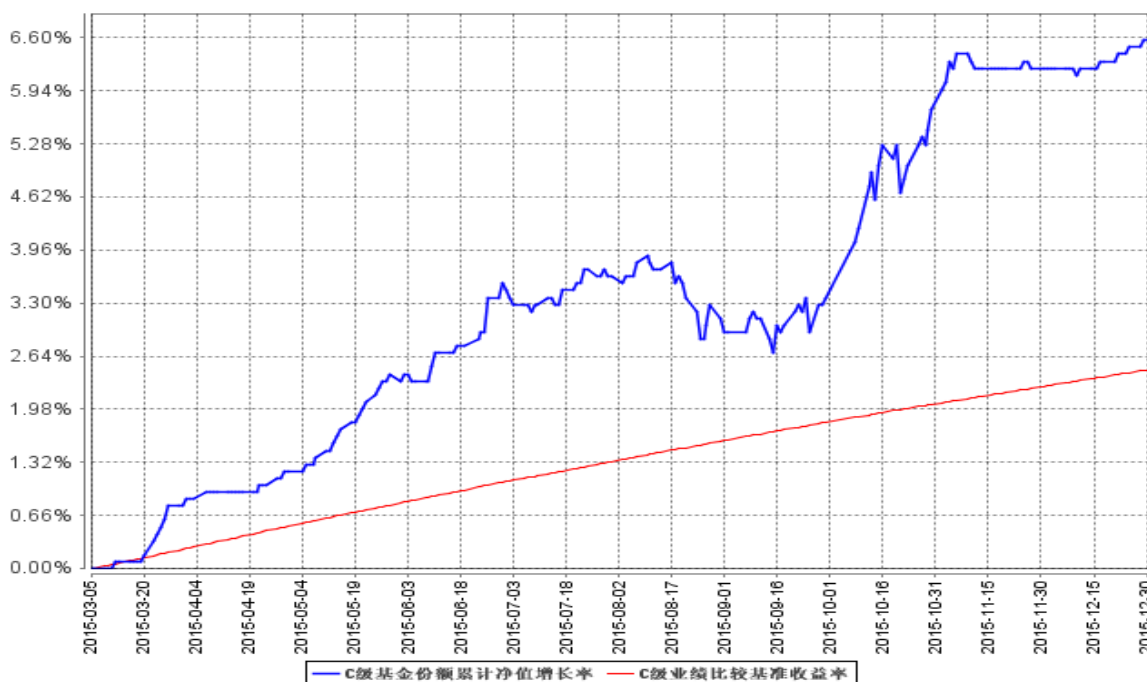
注：自 2015 年 3 月 5 日，本基金实施基金份额分类。融通通泰保本混合 C 的数据统计期间为 2015 年 3 月 5 日至 2015 年 12 月 31 日。

### 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

**A级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**



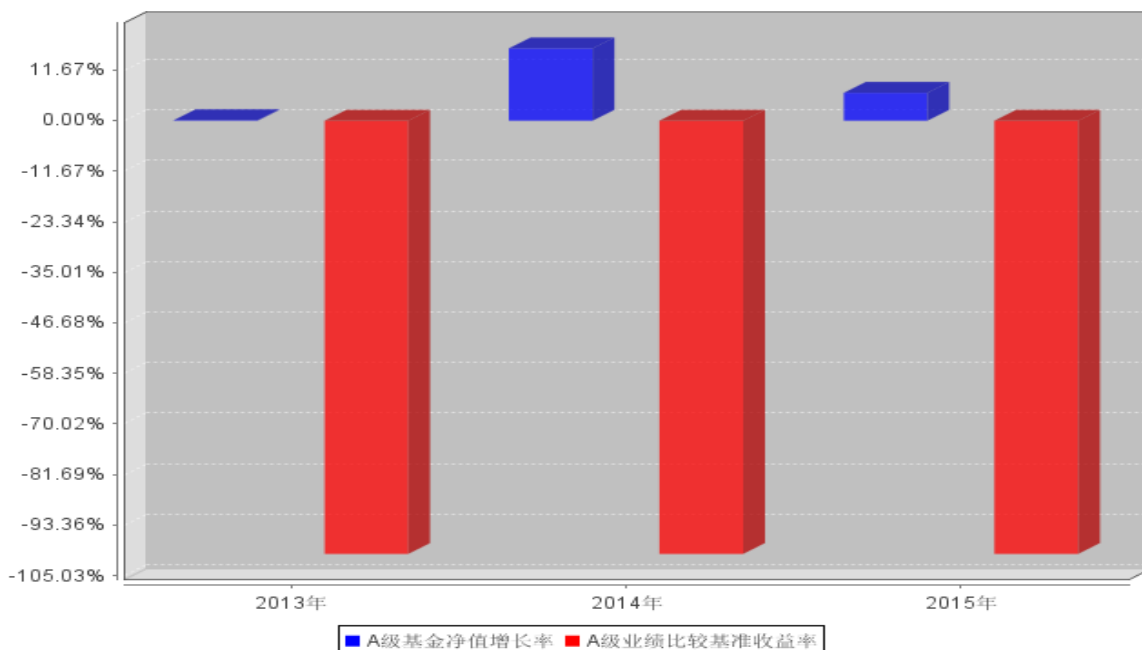
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



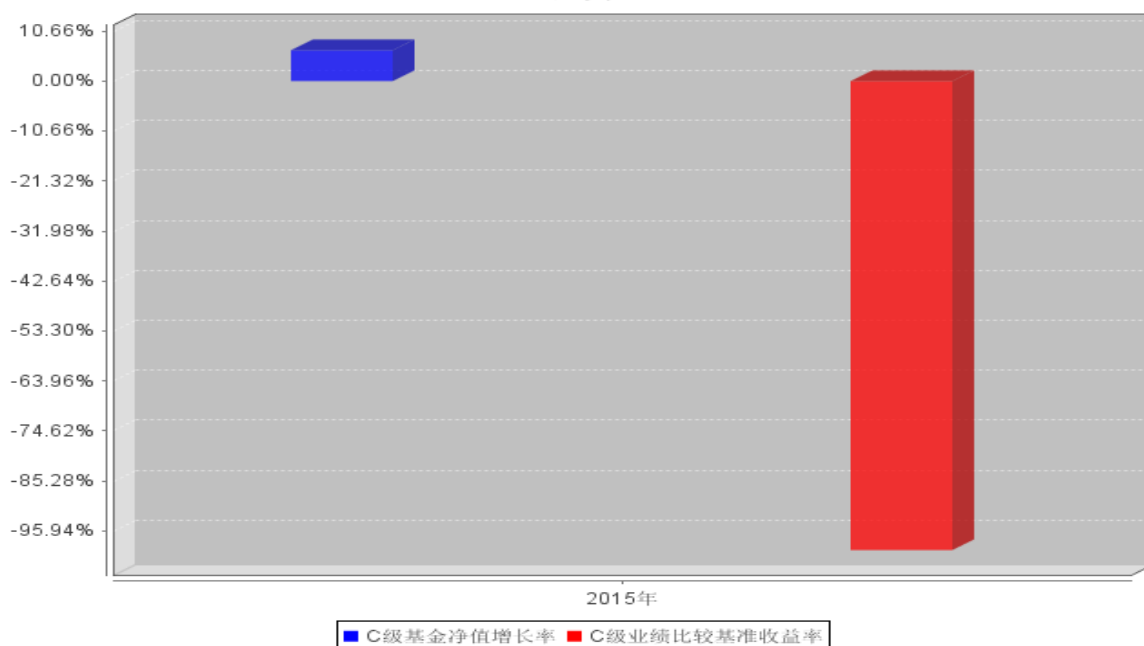
注：自 2015 年 3 月 5 日，本基金实施基金份额分类。融通通泰保本混合 C 的数据统计期间为 2015 年 3 月 5 日至 2015 年 12 月 31 日。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级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



**C级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：1. 本基金的基金合同生效日为 2013 年 5 月 30 日, 合同生效当年按实际存续期计算, 未按整个自然年度进行折算。

2. 2015 年 3 月 5 日, 本基金实施基金份额分类, 融通通泰保本混合 C 的数据统计期间为 2015 年 3 月 5 日至 2015 年 12 月 31 日。

### 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
2013年	-	-	-	-	
2014年	-	-	-	-	
2015年	-	-	-	-	
合计	-	-	-	-	

## §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 2015 年 12 月 31 日，公司管理的基金共有三十七只：一只封闭式基金，即融通通乾封闭基金；三十六只开放式基金，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、融通七天理财债券基金、融通标普中国可转债指数增强基金、融通通泰保本混合基金、融通通泽混合基金、融通通福分级债券基金、融通通源短融债券基金、融通通瑞债券基金、融通月月添利基金、融通健康产业混合基金、融通转型三动力混合基金、融通互联网传媒混合基金、融通新区新经济混合基金、融通通鑫混合基金、融通新能源混合基金、融通军工分级指数基金、融通证券分级指数基金、融通农业分级指数基金、融通跨界成长混合基金、融通新机遇混合基金和融通成长 30 混合基金。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		
余志勇	本基金、融通通泽灵活配置混合、融通通鑫灵活配置混合、融通新机遇灵活配置混合的基金经理	2015 年 3 月 17 日	-	14	金融学硕士，具有基金从业资格。先后任职于湖北省农业厅、闽发证券，2004 年加入招商证券股份有限公司研究发展中心，从事房地产行业研究工作。2007 年加入融通基金管理有限公司，曾任研究部行业研究员、行业组长。
韩海平	本基金、融通债券、融通通福分级债券及融通通瑞债券的基金经理，固定收益部总	2013 年 5 月 30 日	2015 年 6 月 23 日	12	CFA, FRM, 中国科学技术大学经济学硕士、管理科学和计算机科学与技术双学士，具有证券从业资



	监				格。2003 年 10 月至 2007 年 4 月在招商基金管理有限公司工作，从事数量化投资策略研究工作；2007 年 5 月至 2012 年 9 月在中国投瑞银基金管理有限公司工作，历任高级研究员、基金经理、固定收益组副总监；2012 年 9 月加入融通基金管理有
--	---	--	--	--	---

注：任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写；证券从业年限以从事证券业务相关工作的时间为计算标准。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

本基金设计目的主要是保持基金净值增长率的平稳性，操作策略一直保持低仓位，用更多的资金积极参与新股的发行，同时将富余的资金适当的配置在高流动性债券和回购类资产，获得较好的稳定收益，并成功回避了三季度股市的大跌。

三季度 IPO 被暂停，原有的操作策略受到了一定的冲击，本基金在三季度大盘底部适度增持了一部分股票，随着市场估值修复，本基金则逐步降低了股票仓位，整体风险控制得较好。在 11 月份 IPO 重启后，本基金又重新调整到以新股申购为主的策略。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期 A 类基金份额净值增长率为 6.42%，同期业绩比较基准为 3.37%；C 类基金份额净值增长率为 6.57%，同期业绩比较基准为 2.68%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年资本市场会出现大波动、大分化的格局，一方面中国经济依然面临着较大的下行压力，国际环境也存在很多的变数；另一方面中国政府正在全力推行各项改革和和经济转型，资本市场将会不可避免地受到各种因素的冲击呈现大的波动。

本基金 2016 年将重点关注两大类机会：一方面坚定看好新经济的投资机会，例如传媒、云计算等板块，随着中国社会的发展，新消费、新技术领域一定会逐步成为支持社会发展的新动力。另一方面，我们也密切关注传统产业的转型和升级，供给侧改革和新基建将为传统经济带来新的投资机会。

### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照《融通基金管理有限公司证券投资基金估值业务原则和程序》进行，公司设立由研究部、风险管理部、登记清算部、固定收益部、国际业务部和监察

稽核部共同组成的估值委员会，通过参考行业协会估值意见、参考独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员不包含基金经理。

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

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

## **§5 托管人报告**

### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期内，本基金托管人在对融通通泰保本混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，融通通泰保本混合型证券投资基金的管理人——融通基金管理有限公司在融通通泰保本混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### **5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

本托管人依法对融通基金管理有限公司编制和披露的融通通泰保本混合型证券投资基金

2015 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §6 审计报告

本基金 2015 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(2016)第 21177 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：融通通泰保本混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	575,661,149.61	41,451,723.42
结算备付金	138,546.65	12,144,261.09
存出保证金	350,772.05	37,785.60
交易性金融资产	1,515,474,324.70	318,996,400.00
其中：股票投资	54,321,781.50	31,331,900.00
基金投资	-	-
债券投资	1,461,152,543.20	287,664,500.00
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	650,001,415.00	-
应收证券清算款	2,701,439.64	1,994,590.32
应收利息	17,256,393.64	4,285,446.74
应收股利	-	-
应收申购款	2,055,107.05	47,431.90
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,763,639,148.34	378,957,639.07
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2015 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2014 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	-	119,999,966.20
应付证券清算款	-	82,057.02
应付赎回款	109,586.90	255,437.50
应付管理人报酬	2,851,604.37	269,020.55
应付托管费	475,267.37	44,836.79
应付销售服务费	1,352,129.64	-
应付交易费用	164,322.80	69,799.20
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	61,074.60	63,082.49
负债合计	5,013,985.68	120,784,199.75
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	2,235,619,768.47	221,112,035.67
未分配利润	523,005,394.19	37,061,403.65
所有者权益合计	2,758,625,162.66	258,173,439.32
负债和所有者权益总计	2,763,639,148.34	378,957,639.07

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，融通通泰保本基金份额总额 2,235,619,768.47 份；其中 A 类基金份额净值为 1.243 元，基金份额为 117,932,513.37 份；C 类基金份额净值为 1.233 元，基金份额为 2,117,687,255.10 份。

## 7.2 利润表

会计主体：融通通泰保本混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	356,945,838.43	64,507,861.62
1. 利息收入	91,474,759.83	27,555,259.78
其中：存款利息收入	28,301,629.27	1,931,926.72
债券利息收入	41,283,272.28	25,537,141.90
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	21,889,858.28	86,191.16
其他利息收入	-	-
2. 投资收益	255,760,472.62	14,641,082.02

其中：股票投资收益	246,526,527.05	12,487,148.54
基金投资收益	-	-
债券投资收益	9,066,238.07	2,096,333.48
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	167,707.50	57,600.00
3. 公允价值变动收益	5,194,847.51	21,175,065.35
4. 汇兑收益	-	-
5. 其他收入	4,515,758.47	1,136,454.47
<b>减：二、费用</b>	<b>86,413,641.16</b>	<b>11,108,513.01</b>
1. 管理人报酬	49,925,210.28	4,481,059.02
2. 托管费	8,320,868.44	746,843.25
3. 销售服务费	23,874,206.66	-
4. 交易费用	1,777,466.81	148,801.12
5. 利息支出	2,154,303.11	5,329,888.12
其中：卖出回购金融资产支出	2,154,303.11	5,329,888.12
6. 其他费用	361,585.86	401,921.50
<b>三、利润总额</b>	<b>270,532,197.27</b>	<b>53,399,348.61</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润</b>	<b>270,532,197.27</b>	<b>53,399,348.61</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通通泰保本混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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)	221,112,035.67	37,061,403.65	258,173,439.32
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	270,532,197.27	270,532,197.27
三、本期基金份额交易 产生的基金净值变动数	2,014,507,732.80	215,411,793.27	2,229,919,526.07
其中：1. 基金申购款	12,299,687,378.58	2,206,790,537.49	14,506,477,916.07
2. 基金赎回款	-10,285,179,645.78	-1,991,378,744.22	-12,276,558,390.00
四、本期向基金份额持 有人分配利润产生的基	-	-	-

金净值变动			
五、期末所有者权益 (基金净值)	2,235,619,768.47	523,005,394.19	2,758,625,162.66
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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)	466,640,068.91	602,583.56	467,242,652.47
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数(本 期利润)	-	53,399,348.61	53,399,348.61
三、本期基金份额交易 产生的基金净值变动数	-245,528,033.24	-16,940,528.52	-262,468,561.76
其中: 1. 基金申购款	3,353,411.73	382,845.90	3,736,257.63
2. 基金赎回款	-248,881,444.97	-17,323,374.42	-266,204,819.39
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)	221,112,035.67	37,061,403.65	258,173,439.32

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>孟朝霞</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

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),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期改为采用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》所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 7.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
融通基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
新时代证券股份有限公司(“新时代证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
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	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：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.4.1.1 股票交易

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月 31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	427,949,907.90	42.72%	-	-

##### 7.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
新时代证券	391,241.84	43.00%	10,424.13	10.22%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
新时代证券	-	-	-	-



注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，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。权证交易不计佣金。

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

#### 7.4.4.2 关联方报酬

##### 7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	49,925,210.28	4,481,059.02
其中：支付销售机构的客户维护费	986,921.34	2,499,988.43

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1.20%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 × 1.20% / 当年天数。

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

##### 7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	8,320,868.44	746,843.25

注：支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.20%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 × 0.20% / 当年天数。

##### 7.4.4.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通通泰保本混合 A	融通通泰保本混合 C	合计
融通基金管理有限公司	-	23,874,206.66	23,874,206.66
合计	-	23,874,206.66	23,874,206.66
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通通泰保本混合 A	融通通泰保本混合 C	合计
融通基金管理有限公司	-	-	-
合计	-	-	-

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.60% 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：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.60% ÷ 当年天数。

#### 7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	100,685,356.28	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末，基金管理人主要股东及其控制的机构均未持有本基金份额。

## 7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	75,661,149.61	6,315,202.28	1,451,723.42	39,402.93

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按适用利率计息。

## 7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量 (单位：张)	总金额
新时代证券	122404	14 西南 02	交易所	200,000	20,000,000.00
上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量 (单位：张)	总金额
新时代证券	-	-	-	-	-

## 7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

## 7.4.5 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002778	高科石化	2015 年 12 月 28 日	2016 年 1 月 6 日	新股流通受限	8.50	8.50	5,600	47,600.00	47,600.00	-

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。

#### 7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末及上年度末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

#### 7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末及上年度末无银行间市场债券正回购，因此没有在债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期内无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。(2014 年 12 月 31 日：本基金从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 119,999,966.20 元，于 2015 年 1 月 5 日到期。)

## §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	54,321,781.50	1.97
	其中：股票	54,321,781.50	1.97
2	固定收益投资	1,461,152,543.20	52.87
	其中：债券	1,461,152,543.20	52.87
	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	650,001,415.00	23.52
	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	575,799,696.26	20.83
7	其他各项资产	22,363,712.38	0.81
8	合计	2,763,639,148.34	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	25,757,027.32	0.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	764,359.95	0.03
F	批发和零售业	222,304.44	0.01
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	7,336,208.18	0.27
J	金融业	10,999,765.00	0.40
K	房地产业	8,150,000.00	0.30
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	109,392.21	0.00
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	982,724.40	0.04
S	综合	-	-
	合计	54,321,781.50	1.97

### 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	002157	正邦科技	600,000	12,060,000.00	0.44
2	601288	农业银行	3,405,500	10,999,765.00	0.40
3	600325	华发股份	500,000	8,150,000.00	0.30
4	300271	华宇软件	100,000	4,748,000.00	0.17
5	002615	哈尔斯	180,400	4,360,268.00	0.16
6	600439	瑞贝卡	500,000	3,550,000.00	0.13
7	000687	华讯方舟	100,000	2,702,000.00	0.10
8	603508	思维列控	14,605	1,136,853.20	0.04
9	603999	读者传媒	16,713	982,724.40	0.04
10	300496	中科创达	6,560	918,465.60	0.03

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	601211	国泰君安	104,013,572.58	40.29
2	601985	中国核电	32,649,100.17	12.65
3	600885	宏发股份	24,336,972.02	9.43
4	300186	大华农	21,080,158.46	8.17
5	002157	正邦科技	20,481,296.57	7.93
6	600587	新华医疗	20,058,966.38	7.77
7	300198	纳川股份	16,820,894.22	6.52
8	002007	华兰生物	16,030,778.37	6.21
9	300352	北信源	15,467,086.31	5.99
10	600958	东方证券	13,187,052.83	5.11
11	000422	湖北宜化	11,684,230.10	4.53
12	300364	中文在线	11,537,410.00	4.47
13	601288	农业银行	10,999,765.00	4.26
14	300001	特锐德	10,856,687.00	4.21
15	300166	东方国信	10,622,282.01	4.11
16	600325	华发股份	8,651,900.15	3.35
17	002448	中原内配	8,579,661.00	3.32
18	300349	金卡股份	8,180,888.00	3.17
19	601992	金隅股份	6,686,137.00	2.59
20	600141	兴发集团	6,599,343.00	2.56
21	603729	龙韵股份	5,565,186.77	2.16

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	601211	国泰君安	164,949,435.73	63.89
2	601985	中国核电	126,698,684.30	49.08
3	600958	东方证券	27,479,051.91	10.64
4	600959	江苏有线	23,629,576.58	9.15
5	600885	宏发股份	22,888,712.90	8.87
6	600587	新华医疗	22,550,275.95	8.73
7	300186	大华农	21,542,239.00	8.34
8	002007	华兰生物	17,404,667.92	6.74
9	300364	中文在线	16,399,000.00	6.35
10	300198	纳川股份	11,368,787.46	4.40
11	000422	湖北宜化	10,322,312.10	4.00
12	300352	北信源	7,960,450.00	3.08
13	000024	招商地产	7,745,378.16	3.00
14	002157	正邦科技	7,691,125.21	2.98
15	002749	国光股份	7,068,496.70	2.74
16	300001	特锐德	7,044,433.56	2.73
17	300166	东方国信	6,608,311.38	2.56
18	600030	中信证券	6,422,298.00	2.49
19	300284	苏交科	6,404,333.00	2.48
20	603729	龙韵股份	6,128,493.99	2.37
21	000002	万科A	5,461,698.00	2.12
22	600141	兴发集团	5,451,280.02	2.11
23	603883	老百姓	5,353,891.96	2.07
24	603020	爱普股份	5,320,387.51	2.06

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	481,622,462.78
卖出股票收入（成交）总额	706,337,706.09

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。

#### 8.5 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	211,088,543.20	7.65

2	央行票据	-	-
3	金融债券	633,095,000.00	22.95
	其中：政策性金融债	633,095,000.00	22.95
4	企业债券	83,928,000.00	3.04
5	企业短期融资券	430,701,000.00	15.61
6	中期票据	102,340,000.00	3.71
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,461,152,543.20	52.97

## 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	150419	15 农发 19	5,000,000	500,950,000.00	18.16
2	011501003	15 中石油 SCP003	2,300,000	230,115,000.00	8.34
3	150408	15 农发 08	1,300,000	132,145,000.00	4.79
4	019506	15 国债 06	1,106,430	110,908,543.20	4.02
5	101551055	15 大连万达 MTN001	1,000,000	102,340,000.00	3.71

## 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、处罚的情形。

**8.12.2** 本基金投资的前十名股票中，无投资于基金合同规定备选股票库之处的股票。

**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	350,772.05
2	应收证券清算款	2,701,439.64
3	应收股利	-
4	应收利息	17,256,393.64
5	应收申购款	2,055,107.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,363,712.38

**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 级别	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
融通	1,757	67,121.52	-	-	117,932,513.37	100.00%

通泰保本混合 A						
融通通泰保本混合 C	15	141,179,150.34	2,117,687,255.10	100.00%	0.00	0.00%
合计	1,772	1,261,636.44	2,117,687,255.10	94.72%	117,932,513.37	5.28%

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	融通通泰保本混合 A	901.30	0.0008%
	融通通泰保本混合 C	0.00	0.0000%
	合计	901.30	0.0000%

## 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	份额级别	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	融通通泰保本混合 A	0
	融通通泰保本混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	融通通泰保本混合 A	0
	融通通泰保本混合 C	0
	合计	0

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通通泰保本混合 A	融通通泰保本混合 C
基金合同生效日（2013 年 5 月 30 日）基金份额总额	528,653,648.94	-
本报告期期初基金份额总额	221,112,035.67	-
本报告期基金总申购份额	23,242,884.24	12,276,444,494.34
减：本报告期基金总赎回份额	126,422,406.54	10,158,757,239.24
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”	-	-

"填列)		
本报告期末基金份额总额	117,932,513.37	2,117,687,255.10

## §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) 基金管理人的重大人事变动

1) 2015 年 1 月 30 日，2014 年年度股东会会议决议通过，聘任孟朝霞女士、黄庆华先生担任公司董事；奚星华先生、涂卫东先生不再担任公司董事。公司已于 2015 年 2 月 12 日向中国证券监督管理委员会备案，同时抄送中国证券监督管理委员会深圳监管局。

2) 2015 年 4 月 20 日至 4 月 22 日，股东会 2015 年第二次临时会议决议通过，聘任颜锡廉先生、薛迈雅先生担任公司董事；Blair Pickerell（裴布雷）先生、Frederick Reidenbach（弗莱德）先生不再担任公司董事。公司已于 2015 年 6 月 12 日向中国证券监督管理委员会备案，同时抄送中国证券监督管理委员会深圳监管局；

3) 2015 年 6 月 18 日至 6 月 23 日，股东会 2015 年第四次临时会议决议通过，田德军先生不再担任公司董事长及董事职务，聘任高峰先生担任公司第五届董事会董事及公司第五届董事会董事长；本期间公司已履行完成高峰先生任职流程的监管审批程序，并于 2015 年 8 月 12 日完成董事长工商变更备案程序；

4) 2015 年 9 月 2 日，公司发布公告，聘任刘晓玲女士为公司副总经理。该变更事项，经融通基金管理有限公司第五届董事会第一次会议审议并通过，并按规定向中国证券投资基金业协会报备；

5) 2015 年 9 月 7 日，经融通基金管理有限公司股东会 2015 年第五次临时会议审议并通过，聘任刘宇先生担任公司监事，并按规定完成监事工商变更备案程序。

#### (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变更。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，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)，本年度应支付的审计费用为 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	
新时代证券	1	427,949,907.90	42.72%	391,241.84	43.00%	-
海通证券	1	119,042,726.65	11.88%	105,341.54	11.58%	-
安信证券	2	116,272,795.63	11.61%	106,984.71	11.76%	-
长江证券	1	69,058,190.57	6.89%	62,932.72	6.92%	-
中信建投	1	68,133,534.57	6.80%	62,029.05	6.82%	-
平安证券	2	55,276,650.58	5.52%	49,210.46	5.41%	-
申万宏源	1	40,529,832.75	4.05%	37,079.72	4.08%	-
中信证券	1	37,386,133.07	3.73%	33,083.12	3.64%	-
中金公司	1	34,163,485.45	3.41%	31,133.26	3.42%	-
光大证券	1	23,680,105.53	2.36%	21,579.70	2.37%	-
华泰证券	1	10,196,032.64	1.02%	9,291.59	1.02%	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-

渤海证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准和程序：

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，并能为本基金提供全面的信息服；
- (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、在上述租用的券商交易单元中，华西证券、西部证券、中泰证券和浙商证券共 7 个交易单元为本基金本期新增的交易单元。原申银万国证券交易单元和宏源证券交易单元因两机构合并统一变更为申万宏源证券交易单元。

### 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
新时代证券	671,951,651.66	52.96%	39,190,000,000.00	33.69%	-	-
海通证券	25,398,188.41	2.00%	204,000,000.00	0.18%	-	-
安信证券	475,677,492.52	37.49%	9,280,000,000.00	7.98%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

中信建投	93,683,855.42	7.38%	3,140,000,000.00	2.70%	-	-
平安证券	2,019,890.01	0.16%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	64,500,000,000.00	55.45%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-

融通基金管理有限公司

二〇一六年三月三十日