

融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金
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中证全指证券公司指数分级证券投资基金（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 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	融通证券分级		
场内简称	融通证券		
基金主代码	161629		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 7 月 17 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	104,826,316.77 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2015 年 8 月 3 日		
下属分级基金的基金简称	融通证券	证券 A 基	证券 B 基
下属分级基金的场内简称	融通证券	证券 A 基	证券 B 基
下属分级基金的交易代码	161629	150343	150344
报告期末下属分级基金份额总额	26,782,800.77 份	39,021,758.00 份	39,021,758.00 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证全指证券公司指数。
------	------------------------------

	在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。		
投资策略	本基金采用完全复制法进行投资，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对投资组合进行相应调整。		
业绩比较基准	95%×中证全指证券公司价格指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率（税后）。		
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看，融通证券 A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征；融通证券 B 份额具有高预期风险、预期收益相对较高的特征。		
下属分级基金的风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征。	融通证券 A 份额为稳健收益类份额，具有低预期风险、预期收益相对稳定的风险收益特征。	融通证券 B 份额为积极收益类份额，具有高预期风险、预期收益相对较高的风险收益特征。

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、深圳证券交易所

§ 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 7 月 17 日 (基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-131,047,439.94	-12,765,740.57
本期利润	-138,016,969.91	-14,884,244.55
加权平均基金份额本期利润	-0.3810	-0.0520
本期基金份额净值增长率	-17.65%	-10.71%
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	-0.4751	-0.1730
期末基金资产净值	113,981,110.69	759,908,243.13

期末基金份额净值	1.087	0.881
----------	-------	-------

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 2015 年 7 月 17 日。

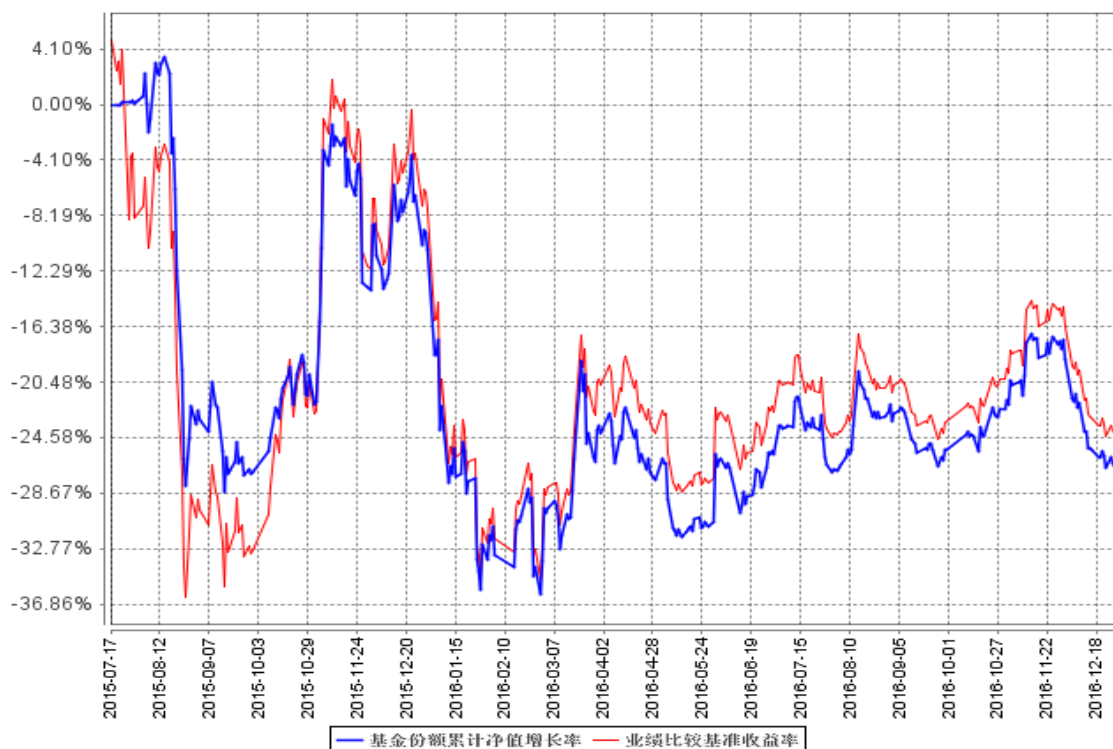
3.2 基金净值表现

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	-1.39%	1.14%	-0.88%	1.12%	-0.51%	0.02%
过去六个月	-1.21%	1.17%	-2.21%	1.17%	1.00%	0.00%
过去一年	-17.65%	2.09%	-17.66%	2.13%	0.01%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-26.47%	2.32%	-24.01%	2.68%	-2.46%	-0.36%

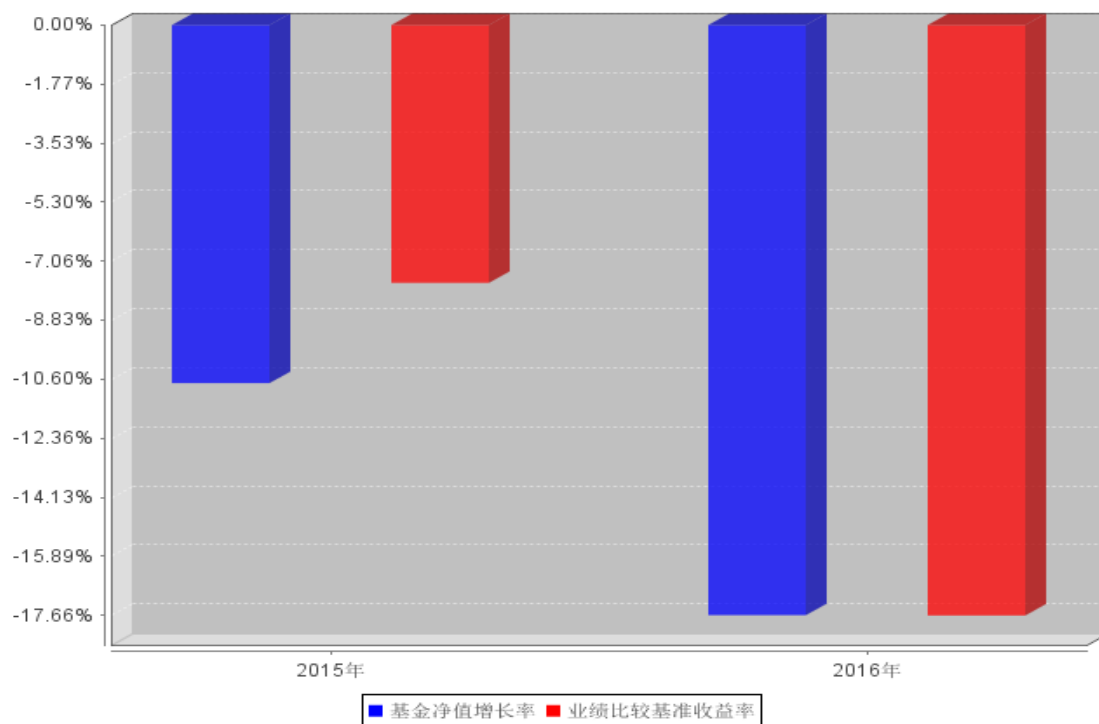
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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：本基金的基金合同生效日为 2015 年 7 月 17 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。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

根据本基金基金合同规定，本基金（包括融通证券份额、融通证券 A 基金份额、融通证券 B 基金份额）不进行收益分配。

§ 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	证券从	说明
----	----	-----------	-----	----

		(助理) 期限		业年限	
		任职日期	离任日期		
何天翔	本基金的基金经理。	2015 年 7 月 17 日	-	8	何天翔先生, 厦门大学经济学硕士、安徽大学理学学士, 8 年证券投资从业经历, 具有基金从业资格。曾就职于华泰联合证券有限公司任金融工程分析师。2010 年 3 月加入融通基金管理有限公司, 历任金融工程研究员、专户投资投资经理, 现任融通深证 100 指数、融通军工分级、融通证券分级、融通中证大农业指数基金 (LOF) (由原融通农业分级转型而来)、融通新趋势灵活配置混合、融通国企改革新机遇灵活配置混合、融通通瑞债券基金的基金经理。

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 年我国宏观经济整体呈 L 型的新常态运行，经济增速和通胀水平保持在合理健康的发展区间。四季度来看，受益于供给侧改革的坚定推进和实体主动补库周期，PPI 于 12 月快速回升至 +5%，PMI 也连续 3 个月站稳 51 以上，同时 CPI 由低位反弹至 2.1%，同时中微观看，重卡、工程机械等中游行业在补库存周期的带动下，销量同比增速好于预期，上市公司 3 季度的业绩增速也出现持续改善。

在严格遵守基金合同的前提下实现持有人利益的最大化是本基金管理的核心思想，并将此原则贯彻于基金的运作始终。本基金运用指数化投资策略，通过控制股票投资权重与中证全指证券公司指数成份股自然权重的偏离，有效控制跟踪误差，为投资者提供投资中证全指证券公司指数的一个有效工具。

本报告期内，本基金日均跟踪偏离为 0.08%，年化跟踪误差为 2.93%，符合基金合同约定。

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-17.65%，同期业绩比较基准收益率为-17.66%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，一季度由于基建投资需求的加码、供给侧改革的推进，预期 PPI 和 CPI 仍将持续高位，同时 2016 年 12 月的新增信贷高达 1.04 万亿元，超出市场预期，并预计 2017 年 1 月份仍将大量信贷投放，主要由于银行储备项目丰富、制造业信贷需求回暖，叠加按揭贷款的滞后效应，因此预计 17 年一季度各项经济指标将持续企稳。全年来看，严控泡沫的地产投资将会下滑，期待改革的持续推进，带来改革红利和结构改善。

证券市场方面，大盘经过 10 月-11 月两个月的持续反弹后，12 月初至今出现了一定调整，主要压制因素包括债市去杠杆、IPO 资金分流效应、汇率大幅上行压力等。展望一季度，中小创短期可能仍将受压于 IPO 持续和高估值，但部分成长性良好的股票估值已经回到较低位，具备投资价值，而大盘指数由于宏观流动性压力缓解、经济弱复苏预期等，保持相对强势。结构上，注重

低估值的优质蓝筹配置，同时关注改革政策相关的主题和真成长个股。

关于证券行业，由于监管层防控金融风险的施政思路持续，所以对创新业务的期待需要适当降低，但同时 IPO 持续加速，直接融资比例不断提升，有利于证券行业的长远发展。同时券商月度的业绩同比增速已于 12 月见底，并预期将逐月开始有所改善，而且目前大型券商的估值已落入历史低位，因此，可以逐渐左侧布局。个股选择上，个股选择上重视业务结构改善明显、综合竞争力提升的优质券商。本基金为参与证券行业投资的投资者提供一个指数化的工具。

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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同约定，本基金（包括融通证券份额、融通证券 A 基金份额、融通证券 B 基金份额）不进行收益分配。

§ 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 21180 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：融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金

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	6,062,545.67	50,827,277.29
结算备付金	-	3,472,736.69
存出保证金	25,403.46	156,994.40
交易性金融资产	107,823,759.32	706,425,593.05
其中：股票投资	107,823,759.32	706,425,593.05
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	338,865.15	-
应收利息	1,375.29	14,503.71

应收股利	-	-
应收申购款	105,136.18	593,672.74
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	114,357,085.07	761,490,777.88
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2016年12月31日	2015年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	110,985.22	49,912.92
应付管理人报酬	102,272.12	592,108.05
应付托管费	22,499.85	130,263.81
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	49,800.96	668,757.54
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	90,416.23	141,492.43
负债合计	375,974.38	1,582,534.75
所有者权益:		
实收基金	154,941,963.52	850,738,948.92
未分配利润	-40,960,852.83	-90,830,705.79
所有者权益合计	113,981,110.69	759,908,243.13
负债和所有者权益总计	114,357,085.07	761,490,777.88

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，融通证券分级份额净值 1.087 元，融通证券 A 份额净值 1.002 元，融通证券 B 份额净值 1.172 元；基金份额总额 104,826,316.77 份，其中融通证券分级份额 26,782,800.77 份，融通证券 A 份额 39,021,758.00 份，融通证券 B 份额 39,021,758.00 份。

7.2 利润表

会计主体：融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金

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	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 7 月 17 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	-130,493,499.10	-12,352,903.08

1. 利息收入	240,124.78	181,655.59
其中：存款利息收入	240,124.78	181,655.59
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	-	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益	-125,501,682.45	-10,809,949.63
其中：股票投资收益	-129,816,160.58	-10,957,263.26
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	4,314,478.13	147,313.63
3. 公允价值变动收益	-6,969,529.97	-2,118,503.98
4. 汇兑收益	-	-
5. 其他收入	1,737,588.54	393,894.94
减：二、费用	7,523,470.81	2,531,341.47
1. 管理人报酬	3,338,101.26	1,119,979.61
2. 托管费	734,382.31	246,395.53
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	3,037,792.14	881,587.27
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	413,195.10	283,379.06
三、利润总额	-138,016,969.91	-14,884,244.55
减：所得税费用	-	-
四、净利润	-138,016,969.91	-14,884,244.55

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金

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）	850,738,948.92	-90,830,705.79	759,908,243.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-138,016,969.91	-138,016,969.91
三、本期基金份额交易产	-695,796,985.40	187,886,822.87	-507,910,162.53

生的基金净值变动数			
其中：1. 基金申购款	1,194,284,046.76	-311,958,622.58	882,325,424.18
2. 基金赎回款	-1,890,081,032.16	499,845,445.45	-1,390,235,586.71
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）	154,941,963.52	-40,960,852.83	113,981,110.69
项目	上年度可比期间		
	2015年7月17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）	240,398,178.85		240,398,178.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-14,884,244.55	-14,884,244.55
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	610,340,770.07	-75,946,461.24	534,394,308.83
其中：1. 基金申购款	932,638,542.90	-83,131,332.25	849,507,210.65
2. 基金赎回款	-322,297,772.83	7,184,871.01	-315,112,901.82
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）	850,738,948.92	-90,830,705.79	759,908,243.13

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	基金管理人、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

本基金本报告期内及上年度可比期间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1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年7月17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	3,338,101.26	1,119,979.61
其中：支付销售机构的客户维护费	307,004.15	61,633.62

注：1、支付基金管理人融通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 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 × 1.00% / 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	上年度可比期间 2015年7月17日(基金合同生效日)
----	-------------------------	--------------------------------

	月 31 日	至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	734,382.31	246,395.53

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 0.22% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.22\% / \text{当年天数}。$$

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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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 2016 年 12 月 31 日		上年度末 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	1,353,532.15	5.05%	2,027,792.09	0.24%

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 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 7 月 17 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	6,062,545.67	218,713.17	50,827,277.29	164,042.48

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、本基金本报告期内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、本基金本报告期内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

本基金无其他关联交易事项的说明。

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

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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
000166	申万宏源	2016/12/21	重大事项	6.25	2017/01/26	6.29	696,625	4,814,006.58	4,353,906.25	-
000750	国海证券	2016/12/15	重大事项	6.97	2017/01/20	6.27	247,870	1,855,032.31	1,727,653.90	-

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。

7.4.4.3 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

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

7.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

§ 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	107,823,759.32	94.29
	其中：股票	107,823,759.32	94.29
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	6,062,545.67	5.30
7	其他各项资产	470,780.08	0.41
8	合计	114,357,085.07	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
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	-	-
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	107,823,759.32	94.60
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	-	-
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	107,823,759.32	94.60

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末无积极投资部分的股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 期末指数投资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	600837	海通证券	920,702	14,501,056.50	12.72
2	600030	中信证券	894,728	14,369,331.68	12.61
3	601688	华泰证券	377,111	6,735,202.46	5.91
4	000776	广发证券	341,721	5,761,416.06	5.05
5	600999	招商证券	335,267	5,474,910.11	4.80
6	600958	东方证券	305,165	4,739,212.45	4.16
7	002736	国信证券	284,500	4,423,975.00	3.88
8	000166	申万宏源	696,625	4,353,906.25	3.82
9	601377	兴业证券	540,929	4,138,106.85	3.63
10	601099	太平洋	785,229	4,043,929.35	3.55

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。

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末无积极投资部分的股票。

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	600030	中信证券	92,023,555.47	12.11
2	600837	海通证券	89,534,105.24	11.78
3	601099	太平洋	48,611,835.32	6.40
4	600999	招商证券	45,372,522.18	5.97
5	601377	兴业证券	40,170,844.39	5.29
6	000166	申万宏源	38,559,968.51	5.07
7	601688	华泰证券	37,637,241.72	4.95
8	000783	长江证券	34,407,220.10	4.53

9	000776	广发证券	33,440,111.15	4.40
10	601211	国泰君安	21,190,103.22	2.79
11	002673	西部证券	20,884,400.35	2.75
12	600958	东方证券	19,266,026.81	2.54
13	601555	东吴证券	18,256,407.69	2.40
14	601901	方正证券	17,881,415.97	2.35
15	600369	西南证券	17,776,966.00	2.34
16	600109	国金证券	17,733,522.05	2.33
17	002736	国信证券	17,304,520.46	2.28
18	000728	国元证券	15,446,234.94	2.03
19	601788	光大证券	15,272,815.91	2.01
20	000686	东北证券	11,904,644.66	1.57

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	600030	中信证券	174,008,116.09	22.90
2	600837	海通证券	162,086,925.42	21.33
3	600999	招商证券	76,423,813.96	10.06
4	601688	华泰证券	70,773,100.63	9.31
5	000166	申万宏源	60,874,504.39	8.01
6	000776	广发证券	60,648,997.98	7.98
7	601377	兴业证券	58,544,182.45	7.70
8	000783	长江证券	53,641,351.82	7.06
9	601099	太平洋	40,554,448.49	5.34
10	601211	国泰君安	37,200,524.92	4.90
11	601901	方正证券	36,956,460.88	4.86
12	002673	西部证券	34,508,383.48	4.54
13	601555	东吴证券	34,396,870.15	4.53
14	600109	国金证券	31,711,728.85	4.17
15	600369	西南证券	30,340,339.81	3.99
16	600958	东方证券	28,640,102.87	3.77
17	000728	国元证券	27,869,871.05	3.67
18	601788	光大证券	27,437,152.82	3.61
19	002736	国信证券	25,939,902.74	3.41
20	000686	东北证券	19,950,767.88	2.63

21	000750	国海证券	18,387,431.72	2.42
22	002500	山西证券	17,200,241.26	2.26
23	601198	东兴证券	15,218,333.59	2.00

注：“卖出金额”是指卖出股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	699,708,452.54
卖出股票收入（成交）总额	1,161,524,595.72

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

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所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

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：

1、海通证券

2016 年 11 月 28 日，公司收到中国证监会《行政处罚决定书》（[2016]127 号），依据《中华人民共和国证券法》（以下简称《证券法》）的有关规定，证监会对海通证券未按规定审查、了解客户真实身份违法违规行为进行了立案调查、审理，并依法向当事人告知了作出行政处罚的事实、理由、依据及当事人依法享有的权利。当事人海通证券未提出陈述、申辩意见，也未申请听证。本案现已审理终结。根据当事人违法行为的事实、性质、情节和社会危害程度，依据《证券公司监督管理条例》第八十四条的规定，证监会决定：对海通证券责令改正，给予警告，没收违法所得 28,653,000 元，并处以 85,959,000 元罚款。

2、华泰证券

2016 年 11 月 28 日，公司收到中国证监会《行政处罚决定书》（[2016]126 号），依据《中华人民共和国证券法》（以下简称《证券法》）的有关规定，证监会对华泰证券未按规定审查、了解客户真实身份违法违规行为进行了立案调查、审理，并依法向当事人告知了作出行政处罚的事实、理由、依据及当事人依法享有的权利。当事人华泰证券未提出陈述、申辩意见，也未申请听证。本案现已审理终结。根据当事人违法行为的事实、性质、情节和社会危害程度，依据《证券公司监督管理条例》第八十四条的规定，证监会决定：对华泰证券责令改正，给予警告，没收违法所得 18,235,275.00 元，并处以 54,705,825.00 元罚款。

3、广发证券

2016 年 11 月 26 日，公司收到中国证监会《行政处罚决定书》（[2016]128 号），依据《中华人民共和国证券法》（以下简称《证券法》）的有关规定，证监会对广发证券未按规定审查、了解客户真实身份违法违规行为进行了立案调查、审理，并依法向当事人告知了作出行政处罚的事实、理由、依据及当事人依法享有的权利。当事人广发证券未提出陈述、申辩意见，也未要求听证。本案现已审理终结。根据当事人违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度，依据《证券公司监督管理条例》第八十四条的规定，证监会决定：对广发证券责令改正，给予警告，没收违法所得 6,805,135.75 元，并处以 20,415,407.25 元罚款。

4、兴业证券

2016 年 7 月 27 日，兴业证券股份有限公司（以下简称“公司”）及丹东欣泰电气股份有限公司（以下简称“欣泰电气”）IPO 申请文件和公开发行募集文件签字保荐代表人兰翔、伍文祥

收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《行政处罚决定书》（〔2016〕91号）。公司在推荐欣泰电气申请首次公开发行股票并在创业板上市过程中，未遵守业务规则和行业规范，未勤勉尽责地对欣泰电气 IPO 申请文件进行审慎核查，出具的发行保荐书《兴业证券股份有限公司关于丹东欣泰电气股份有限公司之 2012 年度财务报告专项检查自查工作报告》等文件存在虚假记载；在欣泰电气公开发行股票过程中，公司作为主承销商，未审慎核查公开发行募集文件的真实性和准确性，未发现《招股意向书》和《招股说明书》中涉及欣泰电气应收账款、流动资产和经营活动产生的现金流量净额等项目的财务数据存在虚假记载。中国证监会拟决定对公司给予警告，没收保荐业务收入 1,200 万元，并处以 2,400 万元罚款；没收承销股票违法所得 2,078 万元，并处以 60 万元罚款。

本基金依照法律法规及基金合同的约定，采取指数化投资策略，紧密跟踪标的指数。基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。同时，本基金管理人将继续对上述公司进行跟踪研究。

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	25,403.46
2	应收证券清算款	338,865.15
3	应收股利	-
4	应收利息	1,375.29
5	应收申购款	105,136.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	470,780.08

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

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000166	申万宏源	4,353,906.25	3.82	重大事项停牌

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末无积极投资部分的股票。

§ 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

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
融通证券	2,160	12,399.44	5,254,628.15	19.62%	21,528,172.62	80.38%
证券 A 基	78	500,278.95	38,098,308.00	97.63%	923,450.00	2.37%
证券 B 基	1,855	21,035.99	1,799,644.00	4.61%	37,222,114.00	95.39%
合计	4,093	25,611.12	45,152,580.15	43.07%	59,673,736.62	56.93%

9.2 期末上市基金前十名持有人

证券 A 基

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	海通资管—上海银行—海通赢家系列—月月赢集合资产管理计划	15,295,970.00	39.20%
2	海通资管—上海银行—海通赢家系列—年年鑫集合资产管理计划	8,087,000.00	20.72%
3	海通资管—民生—海通年年升集合资产管理计划	6,510,900.00	16.69%
4	中国银河证券股份有限公司	4,789,093.00	12.27%
5	上海明泮投资管理有限公司—明泮 CTA 一号基金	1,410,678.00	3.62%
6	上海明泮投资管理有限公司—明泮全天候一号基金	856,508.00	2.19%
7	中信信托有限责任公司—中信冰剑 12 号管理型金融投资集合资金	546,745.00	1.40%
8	李怡名	527,679.00	1.35%
9	天风证券—招商银行—天风证券点金 2 期集合资产管理计划	450,000.00	1.15%
10	范曦文	99,999.00	0.26%

证券 B 基

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	李文胜	1,037,529.00	2.66%
2	银河资本资产—海通证券—中航信托股份有限公司	1,000,000.00	2.56%
3	周金明	925,100.00	2.37%
4	张剑勇	906,883.00	2.32%
5	徐力佳	868,525.00	2.23%

6	徐力健	814,031.00	2.09%
7	宁汉忠	774,052.00	1.98%
8	施鸿宇	704,221.00	1.80%
9	王瑞芸	628,000.00	1.61%
10	唐玉君	626,929.00	1.61%

注：持有人为场内持有人。

9.3 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	融通证券	5,112.83	0.0191%
	证券 A 基	0.00	0.0000%
	证券 B 基	0.00	0.0000%
	合计	5,112.83	0.0049%

9.4 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	融通证券	0
	证券 A 基	0
	证券 B 基	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	融通证券	0
	证券 A 基	0
	证券 B 基	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通证券分级	证券 A 基	证券 B 基
基金合同生效日（2015 年 7 月 17 日）基金份额总额	240,398,178.85	-	-
本报告期期初基金份额总额	51,630,302.04	405,439,734.00	405,439,735.00
本报告期基金总申购份额	1,136,948,253.51	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	1,281,301,402.54	-	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	119,505,647.76	-366,417,976.00	-366,417,977.00
本报告期末基金份额总额	26,782,800.77	39,021,758.00	39,021,758.00

注：拆分变动份额为本报告期发生的配对转换份额及定期、不定期折算份额。

§ 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

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) 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，专门基金托管部门无重大人事变更。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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人民币 40,000.00 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	
兴业证券	1	1,188,383,151.67	64.24%	1,106,739.24	64.64%	-
长江证券	1	173,654,173.21	9.39%	158,252.83	9.24%	-
中信证券	1	144,895,361.27	7.83%	132,045.52	7.71%	-
国信证券	1	126,256,142.77	6.83%	115,058.59	6.72%	-

华泰证券	1	46,991,745.97	2.54%	42,823.67	2.50%	-
广发证券	1	42,663,646.26	2.31%	39,732.06	2.32%	-
国金证券	1	34,682,091.38	1.87%	32,299.46	1.89%	-
国泰君安	1	26,246,590.89	1.42%	24,443.67	1.43%	-
平安证券	2	22,989,056.39	1.24%	21,409.69	1.25%	-
中金公司	2	19,813,274.46	1.07%	18,134.19	1.06%	-
方正证券	1	13,575,502.76	0.73%	12,371.57	0.72%	-
安信证券	2	7,798,140.60	0.42%	7,106.64	0.42%	-
天风证券	2	1,490,857.44	0.08%	1,358.66	0.08%	-
东北证券	2	422,116.00	0.02%	384.69	0.02%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	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, 新增民生证券、华创证券、华宝证券、东北证券、西南证券、天风证券和光大证券共 11 个交易单元, 终止华宝证券 1 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

本基金本报告期无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

融通基金管理有限公司

二〇一七年三月三十日