

# 融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资 基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本半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8月21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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 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.....	13
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17

6.4 报表附注.....	18
<b>§ 7 投资组合报告.....</b>	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.3 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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
7.6 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.....	37
7.7 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.....	37
7.8 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.....	37
7.9 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.....	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	38
7.12 投资组合报告附注.....	38
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>40</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	40
8.3 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.....	40
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>41</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>42</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
10.2 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.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	42
10.8 其他重大事件.....	44
<b>§ 11 备查文件目录.....</b>	<b>46</b>
11.1 备查文件目录.....	46

11.2 存放地点.....	46
11.3 查阅方式.....	46

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金
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	600,314,222.51 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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。

### 2.3 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
注册地址		深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518053	100033
法定代表人		高峰	王洪章

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
登载基金半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>
基金半年度报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	融通基金管理有限公司	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 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	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	36,957,578.16
本期利润	120,806,928.40
加权平均基金份额本期利润	0.1757
本期加权平均净值利润率	16.94%
本期基金份额净值增长率	18.76%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	1,424,250.69
期末可供分配基金份额利润	0.0024
期末基金资产净值	701,030,508.80
期末基金份额净值	1.1678
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	17.45%

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）。

#### 3.2 基金净值表现

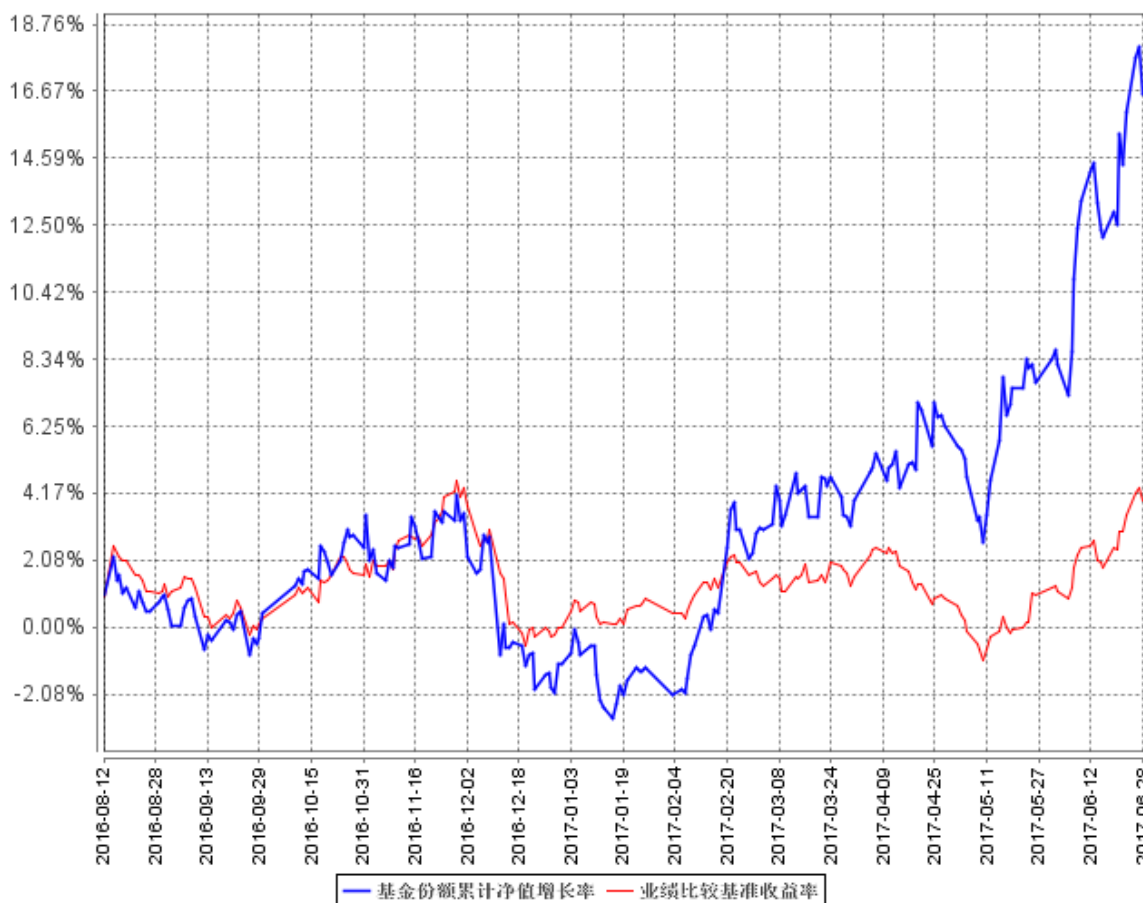
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	8.39%	1.04%	2.93%	0.34%	5.46%	0.70%
过去三个月	12.96%	0.89%	2.58%	0.32%	10.38%	0.57%
过去六个月	18.76%	0.76%	4.18%	0.30%	14.58%	0.46%
自基金合同生效起至今	17.45%	0.73%	4.20%	0.35%	13.25%	0.38%



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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金由通乾证券投资基金转型而来，转型生效日期为 2016 年 8 月 12 日，截至报告期末，本基金转型未满一年。

## 管理人报告

## 3.3 基金管理人及基金经理情况

## 3.3.1 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2017年6月30日，公司共管理六十六只开放式基金：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、融通通福债券基金（LOF）、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、融通通弘债券基金、融通通润债券基金、融通通颐定期开放债券基金、融通人工智能指数基金（LOF）。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。

## 3.3.2 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	2016年8月12日	-	7	张延闽先生，哈尔滨工业大学工学硕士、工学学士，7年证券投资从

	经理				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、融通新蓝筹混合基金的基金经理。
--	----	--	--	--	---

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。

### 3.4 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。

### 3.5 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 3.5.1 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。

#### 3.5.2 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。

### 3.6 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 3.6.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内基金净值增长表现好于市场基准，主要来自三个方面：大类资产配置规避了小股票，目前市场流行蓝筹风格，重仓的个股取得超预期的个股阿尔法。

未来想要在短期内同样取得绝对收益和相对排名靠前是一件很困难的事情。本基金的目标是通过逆向投资策略长期战胜市场，我们认为长期绝对收益是配置资产的唯一标准，而相对排名则是其结果，尤其对于短时间内的绝对回报并无把握。因此，本基金下半年不会为了短期排名去“冒险”，持仓将坚持现有的风格：个股集中、行业龙头和板块均衡。

由于逆向投资策略更看中公司的长期股东回报，因此能进入重点研究的行业和公司并不多。

从结果来看，上半年本基金资产配置集中于白酒、医药、零售、汽车、金融、地产等行业，一旦发现其中有基本面拐点的企业便会对其重仓。现有组合的风险在于部分资产短期估值上升的速度远快于其基本面变化，但目前持仓结构没有看到调整的必要性。一方面个股的长期市值仍然有空间；另一方面暂时没有找到性价比更好的长期资产。未来本基金可能根据风险收益比对于组合内部权重做阶段性调整，但不会出现风格逆转和仓位大幅波动。

### 3.6.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.1678 元；本报告期基金份额净值增长率为 18.76%，业绩比较基准收益率为 4.18%。

### 3.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

最近几个月的微观数据显示中国经济的韧性好于预期。我们始终认为经济数据是一个慢变量，短期不太可能出现暴风骤雨式的波动。目前价格有大幅波动的产品更多源于阶段性的供给不足，并非需求拐点。经济结构转型的过程中，政府在短期稳定和长期效率之间左右平衡。长期来看追求效率可能才是政策的最终目标，因此基建和房地产带来的经济边际贡献趋平，短期盯着宏观数据炒作周期品可能是“螺蛳壳里做道场”。

与此同时，我们发现世界在发生变化——Winner Takes More。根据麦肯锡的报告，这一现象始于 1999 年，并且过往 ROIC 排名靠前的“优等生”最近 5 年给股东创造的价值回报在加速增长。体现在美股市值分布也发生了重构，高盛统计纳斯达克 100 和标普 500 中，前 5 大市值公司占比分别为 42%和 13%。而这背后的推动力量正是行业龙头基本面的变化：这 5 家公司 2018 年收入和利润增长预测中位数分别为 18%和 16%，同期纳斯达克指数增速预期 8%和 13%。无独有偶，在国内的汽车、家电、零售、地产、白酒、煤炭等行业，我们观察到收入分布也在向龙头集中。国内市场份额集中的原因可能来自政策，如央企重组，也可能来自企业内生经营的结果，如汇川技术和英威腾上市时间和市值相差无几，但目前市值相差了 7 倍。同时在某些重资产行业，在行业高歌猛进的时候担忧的是“资产荒”，而现在需求饱和后却面临着“负债荒”，即低成本获得负债的能力。中国的利率二元结构可能导致中小企业加速退出重资产行业。综上所述，我们更多的花精力研究那些可能发生市值重构的行业以及 ROE 可能出现拐点的行业龙头。

投资世界长期属于乐观者，因此本基金保持一个中高仓位。股票市场的波动率呈现肥尾分布，波动率的极值严重影响了长期复合收益率。“申万活跃指数”的最终结局告诉我们抑制人性的冲动有多么重要。最后，一句话总结本基金下半年的投资展望：研究大股票，想想如何做多。

### 3.8 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指定人员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验，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，风险管理部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。

### 3.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

### 3.10 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

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

## § 4 托管人报告

### 4.1 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。

### 4.2 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。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 4.3 托管人对本半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。

## § 5 半年度财务会计报告（未经审计）

## 5.1 资产负债表

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

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	59,856,498.79	62,872,594.84
结算备付金		2,141,785.52	2,055,236.57
存出保证金		283,630.50	305,557.02
交易性金融资产	6.4.7.2	613,228,970.97	843,375,397.53
其中：股票投资		613,228,970.97	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	30,000,135.00	-
应收证券清算款		331,179.33	1,817,493.97
应收利息	6.4.7.5	24,821.44	2,209,336.53
应收股利		-	-
应收申购款		295,356.87	374.46
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		706,162,378.42	912,635,990.92
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		480,135.41	22,765,833.89
应付管理人报酬		835,368.29	1,275,488.16
应付托管费		139,228.03	212,581.37
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	597,255.22	1,060,255.87
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	6.4.7.8	1,249,206.73	1,207,163.83
负债合计		5,131,869.62	28,351,999.06
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	622,325,586.04	932,279,972.99
未分配利润	6.4.7.10	78,704,922.76	-47,995,981.13
所有者权益合计		701,030,508.80	884,283,991.86
负债和所有者权益总计		706,162,378.42	912,635,990.92

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1678 元，基金份额总额 600,314,222.51 份。

## 5.2 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		129,599,117.93
1. 利息收入		601,588.15
其中：存款利息收入	6.4.7.11	322,775.66
债券利息收入		80,922.51
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		197,889.98
其他利息收入		-
2. 投资收益		44,630,377.06
其中：股票投资收益	6.4.7.12	37,929,773.72
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-1,147,372.00
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	7,847,975.34
3. 公允价值变动收益	6.4.7.17	83,849,350.24
4. 汇兑收益		-
5. 其他收入	6.4.7.18	517,802.48
<b>减：二、费用</b>		8,792,189.53
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,324,417.27
2. 托管费	6.4.10.2.2	887,402.86



3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,306,321.53
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.20	274,047.87
<b>三、利润总额</b>		<b>120,806,928.40</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润</b>		<b>120,806,928.40</b>

### 5.3 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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）	932,279,972.99	-47,995,981.13	884,283,991.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	120,806,928.40	120,806,928.40
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-309,954,386.95	5,893,975.49	-304,060,411.46
其中：1. 基金申购款	9,884,433.50	577,533.41	10,461,966.91
2. 基金赎回款	-319,838,820.45	5,316,442.08	-314,522,378.37
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）	622,325,586.04	78,704,922.76	701,030,508.80

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张帆	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

## 5.4 报表附注

### 5.4.1 基金基本情况

融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金是根据原通乾证券投资基金(以下简称“基金通乾”)基金份额持有人大会 2016 年 7 月 7 日决议通过的《关于通乾证券投资基金转型有关事项的议案》，并经中国证券监督管理委员会备案，由原基金基金通乾转型而来。原基金基金通乾为契约型封闭式基金，于上海证券交易所(以下简称“上交所”)交易上市，存续期限为 15 年期。根据上交所《关于终止通乾证券投资基金上市的决定》(上海证券交易所自律监管决定书[2016]193 号)，原基金基金通乾于 2016 年 8 月 12 日终止上市。自 2016 年 8 月 12 日起，原基金基金通乾终止上市，并更名为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”)。原《通乾证券投资基金基金合同》终止，《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》于同一日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期间不定。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

原基金通乾于基金合同终止前的基金资产净值 1,918,192,514.64 元已于本基金的基金合同生效日(2016 年 8 月 12 日)全部转为本基金的基金资产净值。根据《融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》和《融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金集中申购结果暨原通乾证券投资基金基金份额折算结果的公告》，本基金以 2016 年 9 月 1 日为基金份额折算基准日对投资人持有的原基金通乾份额进行了折算，折算比例为 0.964605552，并由登记机构融通基金管理有限公司完成了变更登记。

本基金于基金合同生效后自 2016 年 8 月 16 日至 2016 年 8 月 30 日期间内开放集中申购，共募集 1,053,025.01 元，其中包括折合为基金份额的集中申购资金利息 372.19 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1165 号审验报告予以验证。上述集中申购募集资金已按基金份额净值 1.0000 元折合为 1,053,025.01 份基金份额，其中包括集中申购资金利息折合的 372.19 份基金份额，并于 2016 年 9 月 1 日进行了确认登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》的有关规定，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会批准发行上市的股票)、固定收益类资产(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款等)、股指期货与权证等金融衍生工具、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金投资组合中，股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%；每个交易日日终在扣除股指期货

合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 X 50%+中债综合全价(总值)指数收益率 X 50%。

#### 5.4.2 会计报表的编制基础

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

#### 5.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 5.4.4 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

本基金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一致。

#### 5.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 5.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%

计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 5.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 5.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2017 年 6 月 30 日
活期存款	59,856,498.79
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	59,856,498.79

##### 5.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	482,974,467.16	613,228,970.97	130,254,503.81
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	482,974,467.16	613,228,970.97	130,254,503.81

##### 5.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

## 5.4.7.4 买入返售金融资产

## 5.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	30,000,135.00	-
合计	30,000,135.00	-

## 5.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

## 5.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	21,391.48
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	963.80
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	2,338.56
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	127.60
合计	24,821.44

## 5.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

## 5.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	597,120.22
银行间市场应付交易费用	135.00
合计	597,255.22

## 5.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付赎回费	1,262.07
其他应付款	1,000,000.00
预提费用	247,944.66
合计	1,249,206.73

#### 5.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	899,304,867.86	932,279,972.99
本期申购	9,534,865.76	9,884,433.50
本期赎回（以“-”号填列）	-308,525,511.11	-319,838,820.45
本期末	600,314,222.51	622,325,586.04

#### 5.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-49,321,801.47	1,325,820.34	-47,995,981.13
本期利润	36,957,578.16	83,849,350.24	120,806,928.40
本期基金份额交易产生的变动数	13,788,474.00	-7,894,498.51	5,893,975.49
其中：基金申购款	-129,617.02	707,150.43	577,533.41
基金赎回款	13,918,091.02	-8,601,648.94	5,316,442.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,424,250.69	77,280,672.07	78,704,922.76

#### 5.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	306,463.45
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	13,530.04
其他	2,782.17
合计	322,775.66

#### 5.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	868,173,529.56
减：卖出股票成本总额	830,243,755.84
买卖股票差价收入	37,929,773.72

#### 5.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	42,278,280.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	41,147,372.00
减：应收利息总额	2,278,280.00
买卖债券差价收入	-1,147,372.00

#### 5.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属差价收入。

#### 5.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 5.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	7,847,975.34
基金投资产生的股利收益	-
合计	7,847,975.34

#### 5.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	83,849,350.24
——股票投资	82,745,978.24
——债券投资	1,103,372.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-

2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	83,849,350.24

#### 5.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	514,913.58
转换费收入	2,888.90
合计	517,802.48

注：1. 本基金的赎回费率随赎回基金份额持有期限的增加而递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其不低于转换费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 5.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	2,306,321.53
银行间市场交易费用	-
合计	2,306,321.53

#### 5.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	198,356.09
其他费用	650.00
银行费用	7,453.21
债券托管户维护费	18,000.00
合计	274,047.87

#### 5.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 5.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。



#### 5.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需要作披露的资产负债表日后事项。

#### 5.4.9 关联方关系

##### 5.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 5.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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。

#### 5.4.10 本报告期的关联方交易

##### 5.4.10.1 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。

##### 5.4.10.2 关联方报酬

###### 5.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,324,417.27
其中：支付销售机构的客户维护费	234,426.16

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。

###### 5.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	887,402.86

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：

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

#### 5.4.10.3 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。

#### 5.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 5.4.10.4.1 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
	2017年1月1日至2017年6月30日
期初持有的基金份额	25,056,594.78
期间申购/买入总份额	-
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	25,056,594.78
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	4.17%

##### 5.4.10.4.2 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。

##### 5.4.10.5 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	
	2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	59,856,498.79	306,463.45

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。

##### 5.4.10.6 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。

## 5.4.10.7 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。

## 5.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

## 5.4.12 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

## 5.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

#### 5.4.12.2 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
300145	中金环境	2017年6月28日	重大资产重组停牌	16.92	-	-	3,036,883	37,720,750.40	51,384,060.36	-

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 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。

#### 5.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 5.4.12.3.1 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。

##### 5.4.12.3.2 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。

#### 5.4.13 金融工具风险及管理

##### 5.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金在严格控制风险的基础上，寻求基金资产的长期稳定增值。

本基金的基金管理人奉行建设全面风险管理体系、风控优先的政策，在董事会下设立风险控制与审计委员会，负责检查公司合规运作的状况及合规控制的有效性，并对公司的合规控制提出相关要求；在管理层层面设立风险控制委员会，负责建立健全公司的风险管理制度并组织实施，审定公司的业务风险管理政策，审定公司内控管理组织实施方案，审定公司的业务授权方案，审定基金资产组合的风险状况评价分析报告，审定公司各项风险与内控状况评价报告，审定业务风险损失责任人的责任，审定重大业务可行性风险论证，协调突发性重大风险事件的处理；各业务部门在执行业务事项时需遵守相关法律法规，遵守公司业务管理制度，具有根据业务特点控制业

务风险的职责。业务人员是风险控制环节的第一责任人，部门负责人是控制业务风险管理的第一责任人，对部门风险控制措施的实施情况进行管理；风险管理小组由投资经理、金融工程人员和研究员组成，负责制定相关业务风险的识别和度量方法，指导业务部门实施风险的管理和控制，并定期出具投资组合风险报告，进行投资风险分析与绩效评估；督察长和监察稽核部负责监察公司各业务部门在相关法律法规、规章制度和业务流程执行方面的情况，确保既定的风险控制措施得到有效的贯彻执行，发现内控缺失和管理漏洞，提出改进要求和建议，并报告法规和制度的执行情况。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 5.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资（2016 年 12 月 31 日：同）。

#### 5.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严

密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 5.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 5.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等。

##### 5.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	59,856,498.79	-	-	-	59,856,498.79
结算备付金	2,141,785.52	-	-	-	2,141,785.52
存出保证金	283,630.50	-	-	-	283,630.50
交易性金融资产	-	-	-	613,228,970.97	613,228,970.97
买入返售金融资产	30,000,135.00	-	-	-	30,000,135.00
应收证券清算款	-	-	-	331,179.33	331,179.33
应收利息	-	-	-	24,821.44	24,821.44
应收申购款	-	-	-	295,356.87	295,356.87
资产总计	92,282,049.81	-	-	613,880,328.61	706,162,378.42
负债					
应付赎回款	-	-	-	480,135.41	480,135.41
应付管理人报酬	-	-	-	835,368.29	835,368.29
应付托管费	-	-	-	139,228.03	139,228.03
应付交易费用	-	-	-	597,255.22	597,255.22
其他负债	-	-	-	3,079,882.67	3,079,882.67
负债总计	-	-	-	5,131,869.62	5,131,869.62
利率敏感度缺口	92,282,049.81	-	-	608,748,458.99	701,030,508.80
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	62,872,594.84	-	-	-	62,872,594.84
结算备付金	2,055,236.57	-	-	-	2,055,236.57
存出保证金	305,557.02	-	-	-	305,557.02
交易性金融资产	40,044,000.00	-	-	803,331,397.53	843,375,397.53
应收证券清算款	-	-	-	1,817,493.97	1,817,493.97
应收利息	-	-	-	2,209,336.53	2,209,336.53
应收申购款	-	-	-	374.46	374.46
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	105,277,388.43	-	-	807,358,602.49	912,635,990.92
负债					
应付赎回款	-	-	-	22,765,833.89	22,765,833.89
应付管理人报酬	-	-	-	1,275,488.16	1,275,488.16
应付托管费	-	-	-	212,581.37	212,581.37
应付交易费用	-	-	-	1,060,255.87	1,060,255.87
其他负债	-	-	-	3,037,839.77	3,037,839.77
负债总计	-	-	-	28,351,999.06	28,351,999.06
利率敏感度缺口	105,277,388.43	-	-	779,006,603.43	884,283,991.86

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日

孰早者予以分类。

#### 5.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 5.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 5.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 5.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	613,228,970.97	87.48	803,331,397.53	90.85
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-



交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	613,228,970.97	87.48	803,331,397.53	90.85

#### 5.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数收益率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数收益率上升 5%	37,134,988.11	33,017,750.88
2. 沪深 300 指数收益率下降 5%	-37,134,988.11	-33,017,750.88	

#### 5.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## § 6 投资组合报告

### 6.1 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	613,228,970.97	86.84
	其中：股票	613,228,970.97	86.84
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	30,000,135.00	4.25
	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	61,998,284.31	8.78
7	其他各项资产	934,988.14	0.13
8	合计	706,162,378.42	100.00

### 6.2 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	405,862,596.70	57.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	48,105,728.00	6.86
F	批发和零售业	97,390,261.04	13.89
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	5,920,871.16	0.84
J	金融业	55,949,514.07	7.98
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	613,228,970.97	87.48

### 6.3 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

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	1,256,706	69,948,255.96	9.98
2	000568	泸州老窖	1,354,083	68,489,518.14	9.77
3	601933	永辉超市	9,570,738	67,760,825.04	9.67
4	600742	一汽富维	3,018,378	57,681,203.58	8.23
5	600085	同仁堂	1,640,348	57,346,566.08	8.18
6	300145	中金环境	3,036,883	51,384,060.36	7.33
7	600741	华域汽车	2,014,308	48,826,825.92	6.97
8	601668	中国建筑	4,969,600	48,105,728.00	6.86
9	601607	上海医药	1,025,950	29,629,436.00	4.23
10	000729	燕京啤酒	3,304,099	22,203,545.28	3.17
11	601398	工商银行	3,935,000	20,658,750.00	2.95
12	600030	中信证券	1,209,841	20,591,493.82	2.94
13	600104	上汽集团	658,900	20,458,845.00	2.92
14	600036	招商银行	614,775	14,699,270.25	2.10
15	000800	一汽轿车	900,000	9,153,000.00	1.31
16	300059	东方财富	255,408	3,070,004.16	0.44
17	300369	绿盟科技	257,073	2,843,227.38	0.41
18	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.01
19	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
20	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.01
21	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
22	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
23	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
24	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
25	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
26	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
27	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
28	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
29	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
30	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
31	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00

32	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
33	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
34	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
35	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

#### 6.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 6.4.1 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	600742	一汽富维	63,987,096.50	7.24
2	000776	广发证券	51,760,080.67	5.85
3	601668	中国建筑	47,040,701.00	5.32
4	600741	华域汽车	42,096,221.06	4.76
5	600048	保利地产	33,835,537.48	3.83
6	600036	招商银行	32,381,297.63	3.66
7	601607	上海医药	30,695,532.54	3.47
8	600085	同仁堂	26,573,880.39	3.01
9	000039	中集集团	23,527,662.98	2.66
10	601398	工商银行	20,843,990.00	2.36
11	600104	上汽集团	19,508,752.28	2.21
12	300145	中金环境	18,612,062.85	2.10
13	600030	中信证券	18,072,173.55	2.04
14	601998	中信银行	16,520,569.00	1.87
15	001979	招商蛇口	13,413,147.99	1.52
16	002185	华天科技	13,275,531.74	1.50
17	600547	山东黄金	11,607,186.25	1.31
18	000800	一汽轿车	10,867,374.60	1.23
19	000729	燕京啤酒	10,116,607.06	1.14
20	601808	中海油服	8,179,214.72	0.92

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。

##### 6.4.2 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	600016	民生银行	79,007,914.70	8.93

2	300012	华测检测	77,867,264.68	8.81
3	600030	中信证券	69,856,280.50	7.90
4	300145	中金环境	58,794,197.63	6.65
5	000858	五粮液	51,875,677.79	5.87
6	000776	广发证券	50,485,953.05	5.71
7	600085	同仁堂	47,398,548.68	5.36
8	601933	永辉超市	46,172,013.44	5.22
9	600809	山西汾酒	41,791,462.18	4.73
10	601398	工商银行	33,540,208.00	3.79
11	600048	保利地产	32,507,977.59	3.68
12	000568	泸州老窖	30,380,723.55	3.44
13	000860	顺鑫农业	27,524,859.40	3.11
14	000039	中集集团	23,371,349.17	2.64
15	300059	东方财富	22,320,886.08	2.52
16	300369	绿盟科技	21,290,554.95	2.41
17	600036	招商银行	20,676,734.20	2.34
18	601998	中信银行	15,764,558.00	1.78
19	001979	招商蛇口	13,624,880.22	1.54
20	002185	华天科技	13,076,128.72	1.48

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。

#### 6.4.3 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	557,395,351.04
卖出股票收入（成交）总额	868,173,529.56

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。

#### 6.5 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投资。

#### 6.6 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投资。

#### 6.7 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。

#### 6.8 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。

## 6.9 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。

## 6.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 6.10.1 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。

### 6.10.2 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。

## 6.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 6.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

### 6.11.2 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。

### 6.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 6.12 投资组合报告附注

6.12.1 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。

6.12.2 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。

### 6.12.3 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	283,630.50
2	应收证券清算款	331,179.33
3	应收股利	-
4	应收利息	24,821.44
5	应收申购款	295,356.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	934,988.14

### 6.12.4 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。

## 6.12.5 期末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	300145	中金环境	51,384,060.36	7.33	重大资产重组停牌

## § 7 基金份额持有人信息

### 7.1 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
8,042	74,647.38	357,989,753.29	59.63%	242,324,469.22	40.37%

### 7.2 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	557.65	0.0001%

### 7.3 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



## § 8 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年8月12日）基金份额总额	2,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	899,304,867.86
本报告期基金总申购份额	9,534,865.76
减：本报告期基金总赎回份额	308,525,511.11
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	600,314,222.51

## § 9 重大事件揭示

### 9.1 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。

### 9.2 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。

2017 年 6 月 3 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的公告》，经本基金管理人第五届董事会第十八次临时会议决议审议并通过，决定由张帆先生担任公司总经理职务，公司董事长高峰先生不再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。

### 9.3 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。

### 9.4 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。

### 9.5 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)，该事务所自本基金合同生效起至为本基金提供审计服务至今。

### 9.6 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。

### 9.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 9.7.1 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	13,264,297.25	0.93%	12,086.97	0.92%	-

国信证券	2	96,304,495.69	6.78%	87,769.57	6.69%	-
海通证券	1	352,395,402.25	24.79%	328,186.83	25.01%	-
民族证券	1			-	-	-
上海证券	1			-	-	-
申万宏源	1	113,048,482.12	7.95%	105,281.93	8.02%	-
西部证券	1			-	-	-
银河证券	1			-	-	-
中金公司	1	476,149,310.08	33.50%	433,924.44	33.07%	-
中信证券	1	370,241,260.94	26.05%	344,798.99	26.28%	-
中银国际	1			-	-	-

注：1、本基金选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的标准包括以下六个方面：

- (1) 资力雄厚，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，终止信达证券和西南证券交易单元各一个。

## 9.7.2 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	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	153,300,000.00	16.77%	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	31,300,000.00	3.42%	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	729,600,000.00	79.81%	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

## 9.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	融通基金管理有限公司关于新增天津国美基金销售有限公司为代销机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2017-1-6
2	融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金关于新增代销及确权机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2017-1-17
3	融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金关于新增代销及确权机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2017-2-20
4	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加北京肯特瑞财富投资管理有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2017-2-20
5	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司申购及定期定额投资业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2017-2-23
6	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加国盛证券有限责任公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2017-2-27

7	融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金关于新增确权机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2017-2-28
8	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告	证券时报、管理人网站	2017-3-4
9	融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金关于新增代销及确权机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2017-3-23
10	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加上海万得投资顾问有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2017-3-30
11	融通基金管理有限公司关于新增北京乐融多源投资咨询有限公司为代销机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2017-4-6
12	融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金关于新增代销及确权机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2017-4-12
13	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司申购及定期定额投资业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2017-4-22
14	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在中信银行股份有限公司开通定期定额投资业务及基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2017-5-24
15	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告	证券时报、管理人网站	2017-6-3
16	融通基金管理有限公司关于新增上海通华财富资产管理有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2017-6-14
17	融通基金管理有限公司关于新增珠海华润银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2017-6-16

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- (一)《关于通乾证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》
- (二)关于准予通乾证券投资基金变更注册的批复
- (三)《融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金合同》
- (四)《融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (五)《融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- (六)融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- (七)报告期内在指定报刊上披露的各项公告

### 10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 10.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件，或登陆本基金管理人网站 <http://www.rtfund.com> 查询。