

融通通利系列证券投资基金之
融通蓝筹成长证券投资基金
2017 年年度报告摘要

2017 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：2018 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示

融通通利系列证券投资基金由融通债券投资基金、融通深证 100 指数证券投资基金和融通蓝筹成长证券投资基金共同构成。本年度报告为融通通利系列证券投资基金之子基金融通蓝筹成长证券投资基金（以下简称“本基金”）2017 年年度报告。

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《融通通利系列证券投资基金基金合同》规定，于 2018 年 3 月 26 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 2017 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	融通蓝筹成长混合
基金主代码	161605
前端交易代码	161605
后端交易代码	161655
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 9 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	616,131,615.61 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	组合投资，资本增值，为持有人获取长期稳定的投资收益。
投资策略	在对市场趋势判断的前提下，重视仓位选择和行业配

	置，同时更重视基本面分析，强调通过基本面分析挖掘个股。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+中债综合全价（总值）指数收益率×25%
风险收益特征	力求获得超过市场平均水平的收益，承担相应的风险。

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	郭明
	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	http://www.rtfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	55,128,272.16	-110,510,092.13	479,139,051.09
本期利润	72,163,012.80	-170,280,224.99	479,923,232.83
加权平均基金份额本期利润	0.1095	-0.2348	0.4770
本期基金份额净值增长率	9.30%	-16.66%	32.90%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	0.2845	0.1846	0.4344
期末基金资产净值	791,401,481.52	816,229,977.02	1,043,681,825.35
期末基金份额净值	1.284	1.185	1.434

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

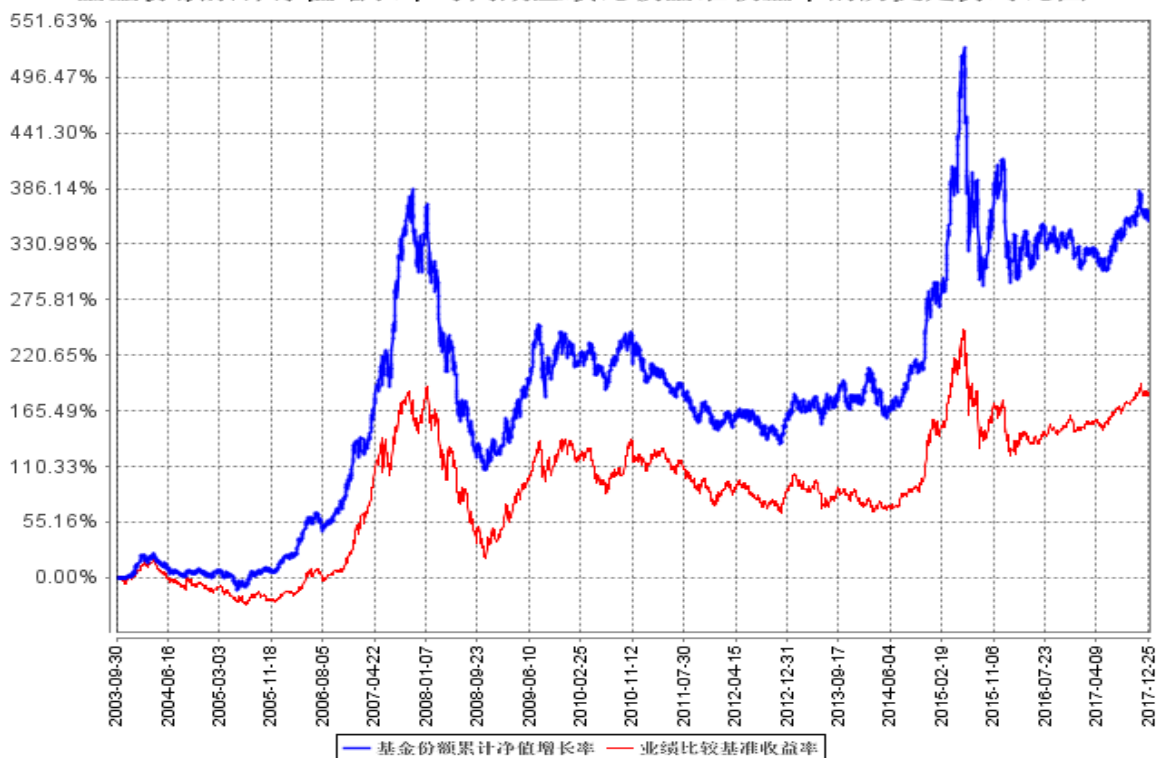
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	0.94%	0.83%	3.52%	0.60%	-2.58%	0.23%
过去六个月	7.27%	0.78%	7.07%	0.52%	0.20%	0.26%
过去一年	9.30%	0.72%	15.04%	0.48%	-5.74%	0.24%
过去三年	21.06%	1.49%	12.66%	1.26%	8.40%	0.23%
过去五年	75.73%	1.35%	50.11%	1.16%	25.62%	0.19%
自基金合同生效起至今	360.22%	1.28%	183.22%	1.31%	177.00%	-0.03%

注：本基金业绩比较基准项目分段计算，其中：2009年12月31日（含此日）之前采用“国泰君安指数×75%+银行间债券综合指数×25%”，2010年1月1日起至2015年9月30日（含此日）采用“沪深300指数收益率×75%+中信标普全债指数收益率×25%”，自2015年10月1日起采用新基准“沪深300指数收益率×75%+中债综合全价（总值）指数收益率×25%”。

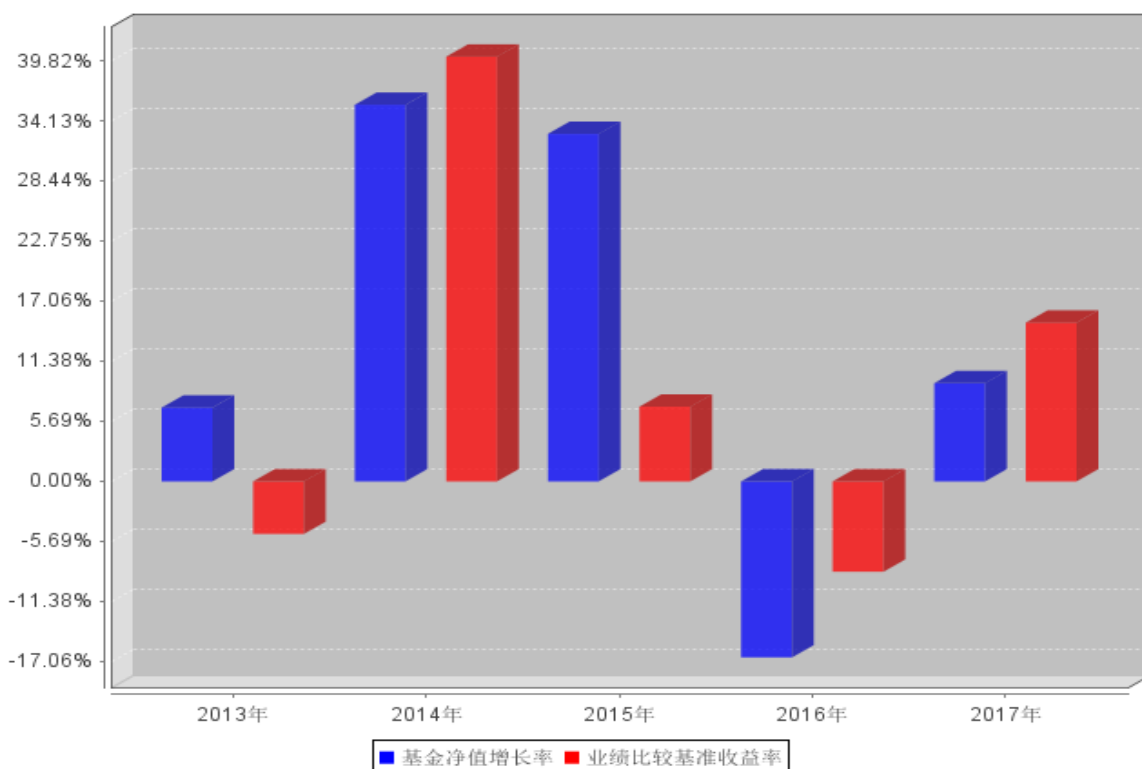
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 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



3.3 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
2017	0.100	2,405,106.18	4,462,632.52	6,867,738.70	
2016	0.100	2,472,683.64	4,802,750.52	7,275,434.16	
2015	3.000	439,645,570.32	217,655,937.30	657,301,507.62	
合计	3.200	444,523,360.14	226,921,320.34	671,444,680.48	

§ 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金字[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12月31日，公司共管理六十五只开放式基金：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、融通动力先锋混合基金、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、融通国企改革新机遇混合基金、融通通尚混合基金、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、融通通穗债券基金、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）、融通新动力灵活配置混合、融通收益增强债券基金和融通中国概念债券基金（QDII）。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		
薛冀颖	本基金的基金经理	2015 年 6 月 19 日	-	6	薛冀颖先生，清华大学工学博士、西安电子科技大学工学学士，6 年证券投资从业经历，具有基金从业资格。历任鹏华基金管理有限公司研究员。2014 年 9 月加入融通基金管理有限公司，现任融通蓝筹成长混合基金的基金经理。

注：任免日期指根据基金管理人对外披露的任免日期填写；证券从业年限以从事证券业务相关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

2017 年市场分化较大，虽然整体市场有较多个股下跌，但低估值蓝筹特别是家电、食品饮料等行业的公司股价表现突出。一季度蓝筹成长基金在消费板块配置比例不高，同时配置的一些周期股和成长股表现不佳影响了净值表现。二季度蓝筹成长基金增加了在家电、食品饮料和金融股方面的配置，对净值表现有积极的贡献，三季度蓝筹成长基金在继续增持一些优质蓝筹和成长股的同时，增加了一定比例周期股的配置，其中周期股对净值的正贡献较大。四季度蓝筹成长基金在配置上向行业龙头公司更加集中，基本契合了市场风格，不过周期股有一定调整，对净值稍有影响。简而言之，17 年蓝筹成长基金持仓相对均衡，配置上基本契合市场偏好优质公司的风格，不过在消费板块的配置相对有些偏低。

4.4.2 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 1.284 元；本报告期基金份额净值增长率为 9.30%，业绩比较基准收益率为 15.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经过供给侧改革、房地产去库存、金融去杠杆后，中国经济已展现出较强的韧性，预计在较长时期内大概率能够保持平稳增长，国内外投资者对中国经济发展的信心也在逐渐增强，在此背景下，伴随着理财产品刚兑的打破和房地产投资属性的降低，股市有望有新增资金进场，从而推动市场的稳健上涨。从市场风格来看，预计 18 年市场风格仍然偏好业绩增长稳健、现金流充裕、管理层优秀、发展前景明确的优质公司，主要是从各行业的产业趋势来看，行业龙头公司的竞争优势更加突出，如融资成本更低、研发投入更大、资源获取能力更强等等，同时从资本市场投资角度，新增入场的资金如海外资金也是偏好优质的行业龙头公司。不过 18 年预计行业龙头公司像 17 年大面积较大幅度的上涨较难实现，应该会有所明显分化，基本面出现问题并且估值过高的公司股价会回落，基本面持续向好并且估值相对合理的公司股价才能继续上涨。另外 17 年市场对市值较大的公司更加偏好，预计 18 年会更侧重公司质地的选择，总体而言，未来的市场选股更加重要，需要对各行业的景气变化和未来的发展潜力有深入的认知，在此基础上，对公司的竞争优势、治理结构、发展前景、财务状况、盈利增长的可持续性等因素进行综合考量，选出质地优秀的公司，并择时进行配置。

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、参考独立第三方估值服务机构的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本基金基金经理。

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与基金托管人核对，同时负责对外进行信息披露。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。本基金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。

截至本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签订服务协议，由其提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人于 2017 年 1 月 19 日实施利润分配，以 2016 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 0.10 元。

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

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。

§ 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蓝筹成长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，融通蓝筹成长证券投资基金的管理人——融通基金管理有限公司在融通蓝筹成

长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。本报告期内，融通蓝筹成长证券投资基金对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为 6,867,738.70 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

本托管人依法对融通基金管理有限公司编制和披露的融通蓝筹成长证券投资基金 2017 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 2017 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(2018)第 22320 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：通利系列证券投资基金-融通蓝筹成长证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	77,688,497.10	127,326,751.33
结算备付金	6,184,221.93	4,691,205.38
存出保证金	629,950.96	704,266.85
交易性金融资产	693,147,542.22	685,822,967.15
其中：股票投资	523,269,542.22	475,447,967.15
基金投资	-	-
债券投资	169,878,000.00	210,375,000.00
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	15,780,816.70	2,663,950.71
应收利息	4,892,074.73	5,030,491.63
应收股利	-	-
应收申购款	85,215.13	42,507.58
递延所得税资产	-	-

其他资产	-	-
资产总计	798,408,318.77	826,282,140.63
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2017年12月31日	2016年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	2,688,588.30
应付赎回款	458,450.41	1,367,884.67
应付管理人报酬	1,013,937.55	1,059,008.00
应付托管费	168,989.58	176,501.33
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,267,127.27	2,661,448.43
应交税费	1,249,200.00	1,249,200.00
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	849,132.44	849,532.88
负债合计	7,006,837.25	10,052,163.61
所有者权益:		
实收基金	616,131,615.61	689,010,366.15
未分配利润	175,269,865.91	127,219,610.87
所有者权益合计	791,401,481.52	816,229,977.02
负债和所有者权益总计	798,408,318.77	826,282,140.63

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.284 元，基金份额总额

616,131,615.61 份。

7.2 利润表

会计主体：通利系列证券投资基金-融通蓝筹成长证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年12月31日
一、收入	103,396,696.89	-130,754,006.96
1. 利息收入	6,436,089.56	7,038,696.72
其中：存款利息收入	651,213.27	509,376.08
债券利息收入	5,784,876.29	6,520,938.51
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	8,382.13

其他利息收入	-	-
2. 投资收益	79,909,433.85	-78,057,131.76
其中：股票投资收益	76,359,287.21	-79,310,317.96
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-680,685.00	130,390.70
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	4,230,831.64	1,122,795.50
3. 公允价值变动收益	17,034,740.64	-59,770,132.86
4. 汇兑收益	-	-
5. 其他收入	16,432.84	34,560.94
减：二、费用	31,233,684.09	39,526,218.03
1. 管理人报酬	12,003,741.81	13,189,145.86
2. 托管费	2,000,623.62	2,198,191.01
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	16,995,432.66	23,902,027.76
5. 利息支出	-	11,474.13
其中：卖出回购金融资产支出	-	11,474.13
6. 其他费用	233,886.00	225,379.27
三、利润总额	72,163,012.80	-170,280,224.99
减：所得税费用	-	-
四、净利润	72,163,012.80	-170,280,224.99

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：通利系列证券投资基金-融通蓝筹成长证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	689,010,366.15	127,219,610.87	816,229,977.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	72,163,012.80	72,163,012.80
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-72,878,750.54	-17,245,019.06	-90,123,769.60
其中：1. 基金申购款	21,007,338.66	4,199,164.07	25,206,502.73
2. 基金赎回款	-93,886,089.20	-21,444,183.13	-115,330,272.33

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-6,867,738.70	-6,867,738.70
五、期末所有者权益（基金净值）	616,131,615.61	175,269,865.91	791,401,481.52
项目	上年度可比期间 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）	727,608,777.88	316,073,047.47	1,043,681,825.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-170,280,224.99	-170,280,224.99
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-38,598,411.73	-11,297,777.45	-49,896,189.18
其中：1. 基金申购款	51,266,137.96	9,417,153.17	60,683,291.13
2. 基金赎回款	-89,864,549.69	-20,714,930.62	-110,579,480.31
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-7,275,434.16	-7,275,434.16
五、期末所有者权益（基金净值）	689,010,366.15	127,219,610.87	816,229,977.02

注：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>张帆</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。

7.4.2 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(“融通基金”)	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(“中国工商银行”)	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”)	基金管理人股东、基金销售机构
日兴资产管理有限公司	基金管理人股东
深圳市融通资本管理股份有限公司	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。

7.4.4 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	2,475,751,556.02	22.01%	4,787,980,503.09	30.20%

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 2017年1月1日至2017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	2,256,156.22	21.81%	525,623.89	16.09%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
新时代证券	4,363,292.54	30.00%	650,738.31	24.46%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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

7.4.4.2 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	12,003,741.81	13,189,145.86
其中：支付销售机构的客户维护费	1,481,944.17	1,613,567.81

注：1. 支付基金管理人融通基金管理有限公司的管理费按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理费 = 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。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,000,623.62	2,198,191.01

注：支付基金托管人中国工商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：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% ÷ 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

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。

7.4.4.4 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

份额单位：份

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
报告期初持有的基金份额	3,860,348.02	3,828,205.24

报告期间申购/买入总份额	-	32,142.78
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	3,860,348.02	3,860,348.02
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.63%	0.56%

注：1. 期间申购/买入总份额含红利再投份额。

2. 基金管理人融通基金管理有限公司上年度申购/买入总份额均为红利再投份额。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017年12月31日		上年度末 2016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	1,589,825.12	0.26%	1,589,825.12	0.23%

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 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	77,688,497.10	569,967.85	127,326,751.33	377,077.97

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.4.7 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（2017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

300664	鹏鹞环保	2017-12-28	2018-01-05	新股未上市	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603161	科华控股	2017-12-28	2018-01-05	新股未上市	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
002923	润都股份	2017-12-28	2018-01-05	新股未上市	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
603080	新疆火炬	2017-12-25	2018-01-03	新股未上市	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

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。

7.4.5.2 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
300383	光环新网	2017-11-07	重大事项停牌	13.19	2018-03-19	14.51	634,474	9,156,204.56	8,368,712.06	-
300730	科创信息	2017-12-25	重大事项停牌	41.55	2018-01-02	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002919	名臣健康	2017-12-28	重大事项停牌	35.26	2018-01-02	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

注：本基金截至 2017 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。

7.4.5.3 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

本基金本报告期末未持有因从事银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因从事交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	523,269,542.22	65.54
	其中：股票	523,269,542.22	65.54
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	169,878,000.00	21.28
	其中：债券	169,878,000.00	21.28
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-

6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	83,872,719.03	10.50
8	其他各项资产	21,388,057.52	2.68
9	合计	798,408,318.77	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	30,351,022.31	3.84
C	制造业	342,848,074.86	43.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	35,562,517.40	4.49
G	交通运输、仓储和邮政业	9,631,125.94	1.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,402,824.61	1.06
J	金融业	77,606,010.70	9.81
K	房地产业	18,819,500.00	2.38
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	32,323.20	0.00
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	523,269,542.22	66.12

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	600887	伊利股份	1,232,464	39,673,016.16	5.01
2	000333	美的集团	550,000	30,486,500.00	3.85
3	002866	传艺科技	682,785	25,133,315.85	3.18
4	601318	中国平安	358,800	25,108,824.00	3.17
5	600702	沱牌舍得	469,691	21,915,782.06	2.77

6	002640	跨境通	1,063,410	20,353,667.40	2.57
7	600048	保利地产	1,330,000	18,819,500.00	2.38
8	002493	荣盛石化	1,205,000	17,291,750.00	2.18
9	600036	招商银行	560,000	16,251,200.00	2.05
10	000858	五粮液	202,000	16,135,760.00	2.04

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	601318	中国平安	94,516,635.18	11.58
2	002008	大族激光	93,493,546.19	11.45
3	000063	中兴通讯	91,914,638.07	11.26
4	000651	格力电器	87,299,486.40	10.70
5	300324	旋极信息	81,776,953.50	10.02
6	600076	康欣新材	80,871,228.64	9.91
7	600887	伊利股份	75,919,492.59	9.30
8	002259	升达林业	70,266,530.81	8.61
9	600703	三安光电	66,622,262.70	8.16
10	600036	招商银行	64,262,694.05	7.87
11	002456	欧菲光	61,846,135.50	7.58
12	300136	信维通信	59,653,535.71	7.31
13	600282	南钢股份	58,991,855.20	7.23
14	002866	传艺科技	58,328,949.03	7.15
15	600801	华新水泥	55,082,994.25	6.75
16	300476	胜宏科技	54,336,066.51	6.66
17	600030	中信证券	52,556,851.30	6.44
18	000333	美的集团	52,262,464.21	6.40
19	002640	跨境通	51,875,853.31	6.36
20	300571	平治信息	49,007,772.80	6.00
21	600782	新钢股份	48,702,074.14	5.97
22	601939	建设银行	47,464,692.49	5.82
23	600702	沱牌舍得	45,686,068.43	5.60
24	600584	长电科技	45,313,218.09	5.55

25	601636	旗滨集团	45,138,976.61	5.53
26	002076	雪莱特	45,134,670.23	5.53
27	601225	陕西煤业	44,019,710.88	5.39
28	600808	马钢股份	42,747,664.60	5.24
29	000050	深天马A	42,688,890.42	5.23
30	000933	*ST神火	41,763,315.78	5.12
31	601288	农业银行	41,162,895.00	5.04
32	002236	大华股份	41,083,252.87	5.03
33	002475	立讯精密	39,890,020.44	4.89
34	002061	*ST江化	39,725,409.94	4.87
35	000967	盈峰环境	39,121,499.19	4.79
36	300630	普利制药	38,132,606.82	4.67
37	600340	华夏幸福	37,659,462.42	4.61
38	601600	中国铝业	37,552,063.00	4.60
39	600362	江西铜业	35,806,128.08	4.39
40	000568	泸州老窖	35,660,131.01	4.37
41	300083	劲胜精密	35,507,955.60	4.35
42	600522	中天科技	35,077,482.40	4.30
43	002430	杭氧股份	34,214,479.08	4.19
44	000983	西山煤电	31,804,478.00	3.90
45	002110	三钢闽光	31,280,176.50	3.83
46	002696	百洋股份	31,202,153.58	3.82
47	603993	洛阳钼业	31,023,379.89	3.80
48	300323	华灿光电	30,706,194.99	3.76
49	000783	长江证券	30,622,903.40	3.75
50	300038	梅泰诺	29,953,694.21	3.67
51	002050	三花股份	29,099,439.00	3.57
52	002126	银轮股份	28,869,158.69	3.54
53	603328	依顿电子	28,853,022.77	3.53
54	002466	天齐锂业	27,135,217.63	3.32
55	600201	生物股份	26,616,000.14	3.26
56	600585	海螺水泥	26,573,988.51	3.26
57	600999	招商证券	26,409,758.61	3.24
58	002479	富春环保	25,711,414.84	3.15
59	000823	超声电子	25,319,548.54	3.10
60	000858	五粮液	25,131,199.99	3.08

61	000666	经纬纺机	25,127,054.74	3.08
62	600754	锦江股份	24,975,759.11	3.06
63	300095	华伍股份	24,452,661.40	3.00
64	000711	京蓝科技	24,352,623.90	2.98
65	300033	同花顺	24,245,354.84	2.97
66	300296	利亚德	24,222,906.00	2.97
67	300310	宜通世纪	23,794,829.64	2.92
68	603127	昭衍新药	23,773,940.45	2.91
69	600711	盛屯矿业	23,729,437.58	2.91
70	002396	星网锐捷	23,412,493.11	2.87
71	600233	圆通速递	23,287,188.00	2.85
72	600176	中国巨石	23,272,725.00	2.85
73	600031	三一重工	23,100,222.00	2.83
74	300365	恒华科技	22,749,172.98	2.79
75	601628	中国人寿	22,660,857.93	2.78
76	601117	中国化学	22,312,203.51	2.73
77	601998	中信银行	22,244,027.43	2.73
78	600595	中孚实业	21,062,188.82	2.58
79	002094	青岛金王	21,018,798.61	2.58
80	600048	保利地产	20,589,176.22	2.52
81	000830	鲁西化工	20,586,231.70	2.52
82	600428	中远海特	20,522,665.87	2.51
83	300164	通源石油	20,493,068.91	2.51
84	601699	潞安环能	19,848,756.00	2.43
85	603898	好莱客	19,708,198.95	2.41
86	603626	科森科技	19,692,709.67	2.41
87	600406	国电南瑞	19,596,452.98	2.40
88	300430	诚益通	19,414,440.83	2.38
89	600019	宝钢股份	19,397,186.00	2.38
90	600110	诺德股份	18,626,552.75	2.28
91	002291	星期六	18,486,726.80	2.26
92	300152	科融环境	18,394,592.23	2.25
93	300394	天孚通信	18,298,703.24	2.24
94	603040	新坐标	18,195,376.00	2.23
95	002493	荣盛石化	18,019,324.24	2.21
96	002044	美年健康	17,791,933.00	2.18

97	000822	山东海化	17,601,477.37	2.16
98	601688	华泰证券	17,412,514.00	2.13
99	600497	驰宏锌锗	17,237,265.67	2.11
100	002573	清新环境	17,174,167.58	2.10
101	000425	徐工机械	17,120,534.00	2.10
102	600259	广晟有色	17,109,631.00	2.10
103	000895	双汇发展	17,045,228.00	2.09
104	000687	华讯方舟	17,032,787.28	2.09
105	000100	TCL 集团	16,743,500.00	2.05
106	300203	聚光科技	16,707,338.33	2.05
107	002128	露天煤业	16,640,232.35	2.04
108	300408	三环集团	16,631,435.47	2.04
109	002635	安洁科技	16,560,801.27	2.03
110	300232	洲明科技	16,487,191.93	2.02
111	300054	鼎龙股份	16,451,848.33	2.02
112	002600	江粉磁材	16,423,997.00	2.01

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	002008	大族激光	102,675,237.77	12.58
2	000063	中兴通讯	102,154,226.88	12.52
3	000651	格力电器	83,051,989.27	10.18
4	601318	中国平安	82,022,623.86	10.05
5	000059	华锦股份	80,957,584.98	9.92
6	600076	康欣新材	79,269,664.47	9.71
7	300324	旋极信息	75,634,448.95	9.27
8	002259	升达林业	69,374,272.30	8.50
9	600801	华新水泥	66,270,447.72	8.12
10	002456	欧菲光	62,845,110.80	7.70
11	300136	信维通信	62,417,928.49	7.65
12	300571	平治信息	56,895,394.35	6.97
13	600703	三安光电	56,353,259.65	6.90
14	600282	南钢股份	56,040,844.75	6.87

15	300476	胜宏科技	53,378,301.68	6.54
16	600782	新钢股份	51,951,370.76	6.36
17	600030	中信证券	51,779,181.04	6.34
18	002475	立讯精密	50,868,867.36	6.23
19	600036	招商银行	50,571,520.96	6.20
20	601636	旗滨集团	48,720,761.09	5.97
21	600808	马钢股份	47,446,039.20	5.81
22	601939	建设银行	46,026,231.34	5.64
23	000711	京蓝科技	45,887,355.68	5.62
24	600584	长电科技	45,340,086.62	5.55
25	002076	雪莱特	44,578,686.08	5.46
26	000933	*ST 神火	44,276,985.23	5.42
27	000050	深天马 A	42,990,743.47	5.27
28	002640	跨境通	40,615,121.56	4.98
29	601288	农业银行	40,449,762.00	4.96
30	300083	劲胜精密	40,304,048.73	4.94
31	002236	大华股份	40,037,283.00	4.91
32	002430	杭氧股份	39,479,834.70	4.84
33	601600	中国铝业	39,251,728.00	4.81
34	601225	陕西煤业	39,112,611.50	4.79
35	300098	高新兴	39,087,560.12	4.79
36	000568	泸州老窖	38,369,466.40	4.70
37	000967	盈峰环境	38,251,877.13	4.69
38	002866	传艺科技	37,686,326.19	4.62
39	600887	伊利股份	37,379,015.66	4.58
40	600691	阳煤化工	36,357,060.32	4.45
41	300630	普利制药	36,304,367.15	4.45
42	600362	江西铜业	36,079,774.07	4.42
43	000983	西山煤电	34,880,308.56	4.27
44	000830	鲁西化工	33,465,489.69	4.10
45	002110	三钢闽光	32,795,925.05	4.02
46	300323	华灿光电	32,363,367.82	3.96
47	600340	华夏幸福	31,729,919.80	3.89
48	601238	广汽集团	31,561,270.00	3.87
49	600999	招商证券	30,890,731.10	3.78
50	002061	*ST 江化	30,829,507.64	3.78
51	300038	梅泰诺	30,367,246.71	3.72
52	002696	百洋股份	30,151,048.44	3.69

53	000783	长江证券	29,030,378.88	3.56
54	600240	华业资本	28,857,884.70	3.54
55	002126	银轮股份	28,740,060.51	3.52
56	002050	三花股份	28,590,470.42	3.50
57	300365	恒华科技	28,172,792.55	3.45
58	600585	海螺水泥	28,029,432.72	3.43
59	600201	生物股份	27,859,918.00	3.41
60	603127	昭衍新药	27,780,570.54	3.40
61	000823	超声电子	27,263,192.28	3.34
62	002466	天齐锂业	27,152,793.52	3.33
63	603986	兆易创新	27,038,848.74	3.31
64	002479	富春环保	26,260,630.08	3.22
65	600754	锦江股份	26,185,965.40	3.21
66	601668	中国建筑	25,881,685.00	3.17
67	603328	依顿电子	25,275,742.86	3.10
68	300296	利亚德	24,782,379.58	3.04
69	600031	三一重工	24,618,008.00	3.02
70	000666	经纬纺机	24,080,369.25	2.95
71	300310	宜通世纪	23,947,391.58	2.93
72	300203	聚光科技	23,931,264.48	2.93
73	300095	华伍股份	23,783,681.62	2.91
74	600702	沱牌舍得	23,469,037.74	2.88
75	000333	美的集团	23,080,766.96	2.83
76	300033	同花顺	23,055,518.24	2.82
77	600233	圆通速递	22,870,628.11	2.80
78	601628	中国人寿	22,649,620.80	2.77
79	600711	盛屯矿业	22,633,745.50	2.77
80	600522	中天科技	22,116,301.00	2.71
81	601998	中信银行	21,750,391.96	2.66
82	000731	四川美丰	21,165,586.24	2.59
83	300430	诚益通	21,116,885.45	2.59
84	000422	湖北宜化	21,063,823.68	2.58
85	601699	潞安环能	20,976,575.60	2.57
86	600110	诺德股份	20,908,287.78	2.56
87	600428	中远海特	20,656,231.48	2.53
88	002217	合力泰	20,557,642.74	2.52
89	000858	五粮液	20,014,427.94	2.45
90	002573	清新环境	19,757,248.52	2.42

91	603626	科森科技	19,668,180.68	2.41
92	600019	宝钢股份	19,396,500.00	2.38
93	601117	中国化学	18,976,205.35	2.32
94	300567	精测电子	18,886,570.39	2.31
95	002094	青岛金王	18,651,232.86	2.29
96	000895	双汇发展	18,565,901.59	2.27
97	300394	天孚通信	18,294,998.20	2.24
98	603993	洛阳钼业	17,970,519.54	2.20
99	000636	风华高科	17,936,288.83	2.20
100	603898	好莱客	17,873,006.04	2.19
101	000100	TCL 集团	17,788,231.00	2.18
102	600803	新奥股份	17,752,790.16	2.17
103	300152	科融环境	17,694,488.74	2.17
104	000425	徐工机械	17,689,027.00	2.17
105	600406	国电南瑞	17,685,821.07	2.17
106	002044	美年健康	17,649,769.30	2.16
107	603040	新坐标	17,352,492.00	2.13
108	600595	中孚实业	17,243,929.04	2.11
109	600497	驰宏锌锗	17,020,953.38	2.09
110	600259	广晟有色	16,981,079.00	2.08
111	000687	华讯方舟	16,918,438.48	2.07
112	300258	精锻科技	16,769,686.86	2.05
113	000822	山东海化	16,585,876.97	2.03
114	002635	安洁科技	16,499,943.52	2.02

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,605,119,597.02
卖出股票收入（成交）总额	5,650,333,174.80

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	39,940,000.00	5.05

2	央行票据	-	-
3	金融债券	129,938,000.00	16.42
	其中：政策性金融债	129,938,000.00	16.42
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	169,878,000.00	21.47

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	170401	17 农发 01	1,100,000	109,978,000.00	13.90
2	019563	17 国债 09	400,000	39,940,000.00	5.05
3	170204	17 国开 04	200,000	19,960,000.00	2.52

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

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	629,950.96
2	应收证券清算款	15,780,816.70
3	应收股利	-
4	应收利息	4,892,074.73
5	应收申购款	85,215.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,388,057.52

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

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
35,460	17,375.40	7,060,641.93	1.15%	609,070,973.68	98.85%

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	10,119.12	0.0016%

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、基金投资和研发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

单位：份

基金合同生效日（2003年9月30日）基金份额总额	766,073,014.14
本报告期期初基金份额总额	689,010,366.15
本报告期基金总申购份额	21,007,338.66
减：本报告期基金总赎回份额	93,886,089.20
本报告期末基金份额总额	616,131,615.61

§ 11 重大事件揭示**11.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**11.2.1 本报告期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。

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。

11.2.2 本报告期基金托管人的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

在本报告期内没有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金的投资策略未发生变更。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今，本年度应支付的审计费用为950,000.00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，基金管理人、托管人及其高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情形。

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	
招商证券	2	2,882,396,680.42	25.63%	2,633,863.58	25.46%	-
新时代证券	1	2,475,751,556.02	22.01%	2,256,156.22	21.81%	-
东兴证券	1	1,356,893,147.89	12.06%	1,263,679.53	12.22%	-
中信建投	1	1,277,869,511.28	11.36%	1,190,075.60	11.50%	-
华泰证券	1	1,164,536,644.84	10.35%	1,061,244.42	10.26%	-
中金公司	1	879,507,560.91	7.82%	819,085.15	7.92%	-
海通证券	1	721,597,149.51	6.42%	672,014.45	6.50%	-
太平洋证券	1	327,313,245.81	2.91%	298,281.10	2.88%	-
西藏东方财 富	1	161,933,166.79	1.44%	150,810.80	1.46%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	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、本报告期内基金新增租用太平洋证券、西藏东方财富证券各 1 个。

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
招商证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	25,000,000.00	62.50%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
海通证券	14,997,000.00	37.50%	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的要求，本基金管理人经与基金托管人协商一致，对本基金合同进行了修订和更新。本次修订和更新仅涉及与《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》相关的条款，包括前言、释义、基金份额的申购与赎回、基金的投资、基金资产估值、基金的信息披露等，具体内容详见 2018 年 3 月 23 日基金管理人网站披露的相关公告和修订更新后的法律文件。

融通基金管理有限公司

二〇一八年三月二十九日