

# 融通通泰保本混合型证券投资基金 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

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 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	1,097,362,463.64 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	1,076,179,930.49 份	21,182,533.15 份

### 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	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	<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	2017 年		2016 年		2015 年	
	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 A	融通通泰保本 混合 C	融通通泰保本 混合 A	融通通泰保本混 合 C
本期 已实 现收 益	10,092,285.76	70,505.93	13,990,096.09	9,260,557.14	7,070,055.16	258,267,294.60
本期 利润	25,276,964.44	352,979.95	-7,597,423.90	-51,047.49	9,863,870.28	260,668,326.99
加 权 平 均 基 金 份 额 本 期 利 润	0.0226	0.0167	-0.0116	-0.0001	0.0650	0.0686
本 期 基 金 份 额	2.34%	1.58%	0.10%	-0.52%	6.42%	6.57%

净值增长率						
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	0.1730	0.1547	0.1637	0.1514	0.1809	0.1712
期末基金资产净值	1,091,883,865.70	21,298,080.94	1,145,935,128.13	20,945,100.99	146,630,379.88	2,611,994,782.78
期末基金份额净值	1.015	1.005	0.992	0.989	1.243	1.233

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 2015 年数据统计期间为 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	0.79%	0.12%	0.69%	0.00%	0.10%	0.12%
过去六个月	1.40%	0.09%	1.38%	0.00%	0.02%	0.09%
过去一年	2.32%	0.08%	2.74%	0.00%	-0.42%	0.08%
过去三年	8.99%	0.14%	8.86%	0.00%	0.13%	0.14%
自基金合同生效起至今	27.31%	0.15%	15.60%	0.00%	11.71%	0.15%

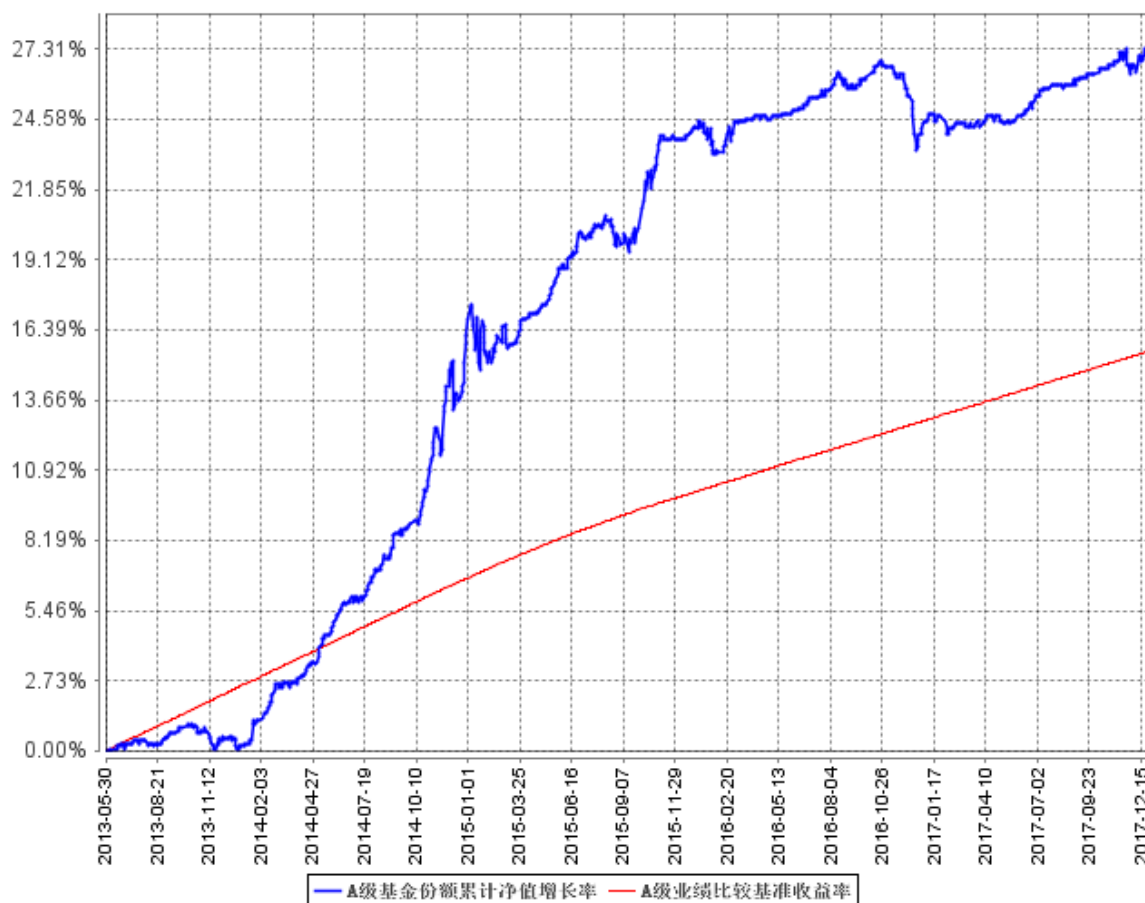
## 融通通泰保本混合 C

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	0.50%	0.13%	0.69%	0.00%	-0.19%	0.13%
过去六个月	1.01%	0.10%	1.38%	0.00%	-0.37%	0.10%
过去一年	1.62%	0.08%	2.74%	0.00%	-1.12%	0.08%
2015 年 3 月 5 日起至今	7.73%	0.11%	15.60%	0.00%	-7.87%	0.11%

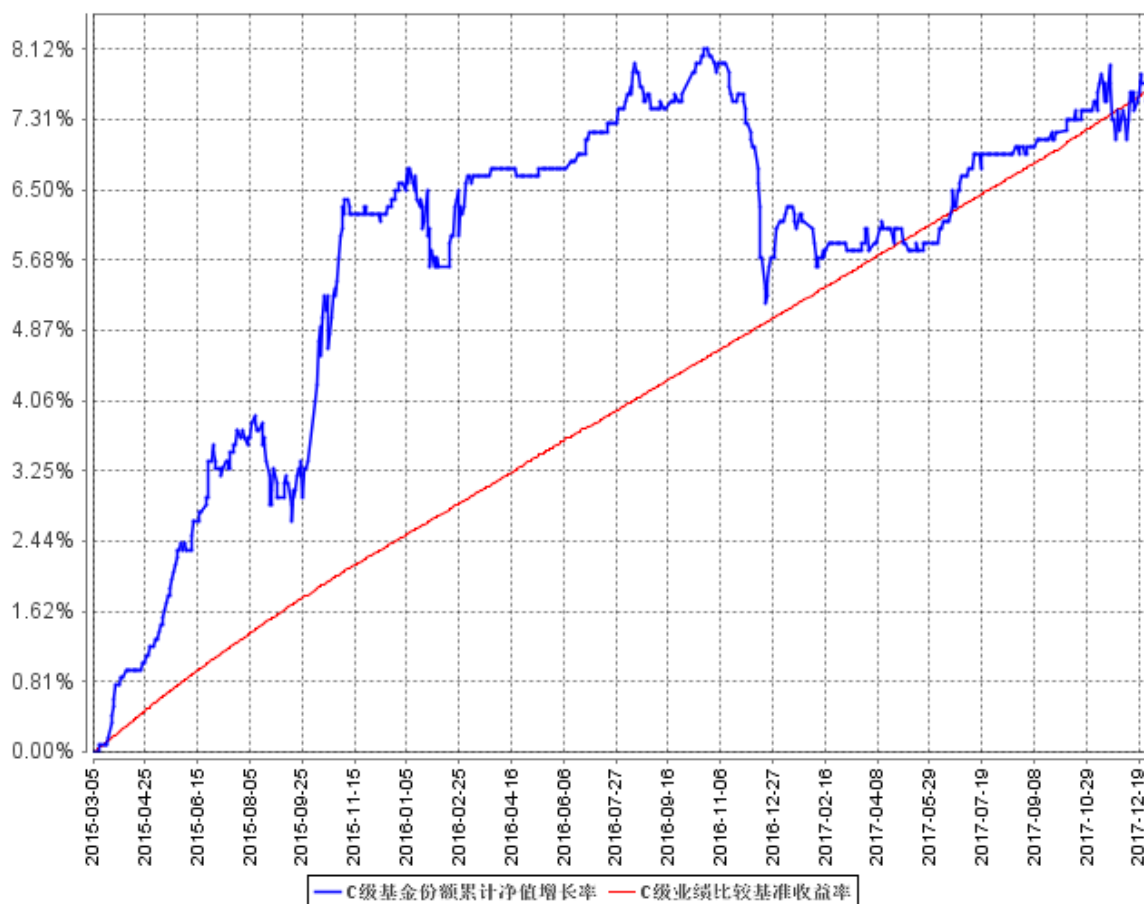
注：自 2015 年 3 月 5 日，本基金实施基金份额分类。融通通泰保本混合 C 的数据统计期间为 2015 年 3 月 5 日至 2015 年 12 月 31 日。

### 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



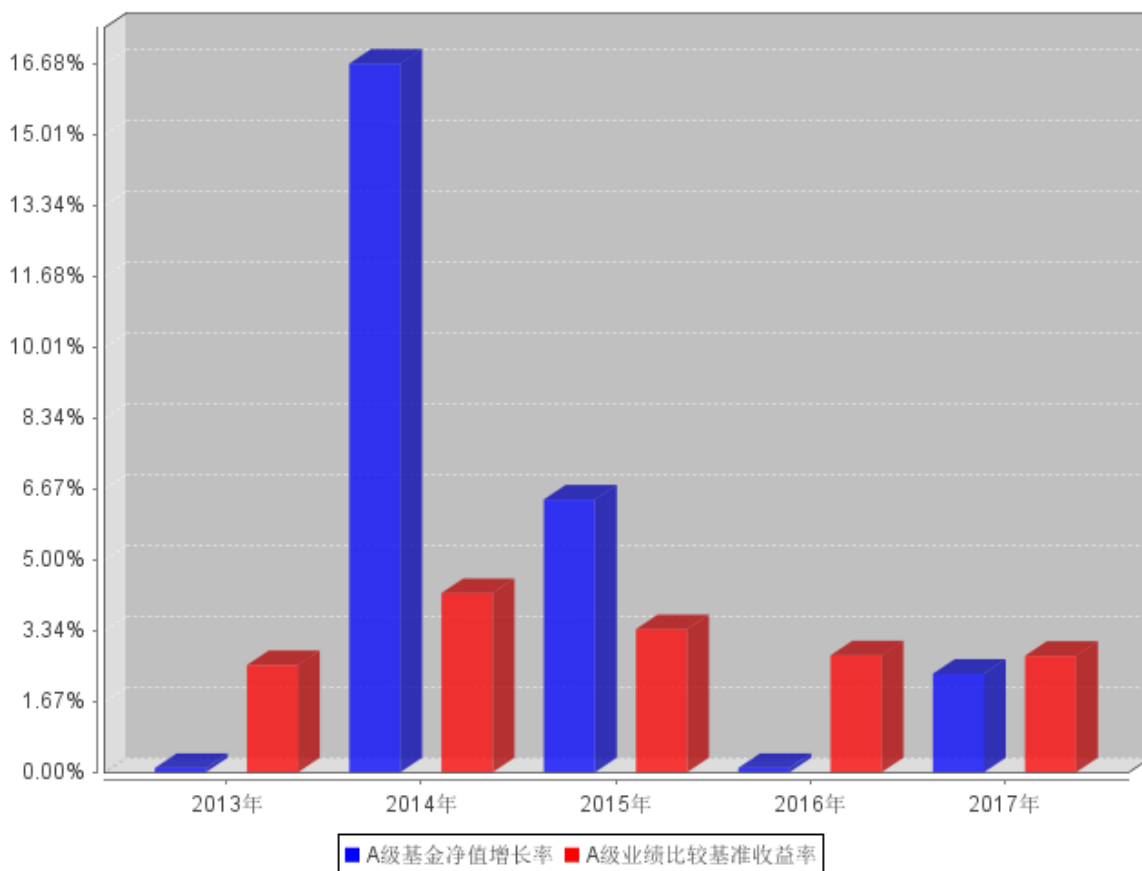
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

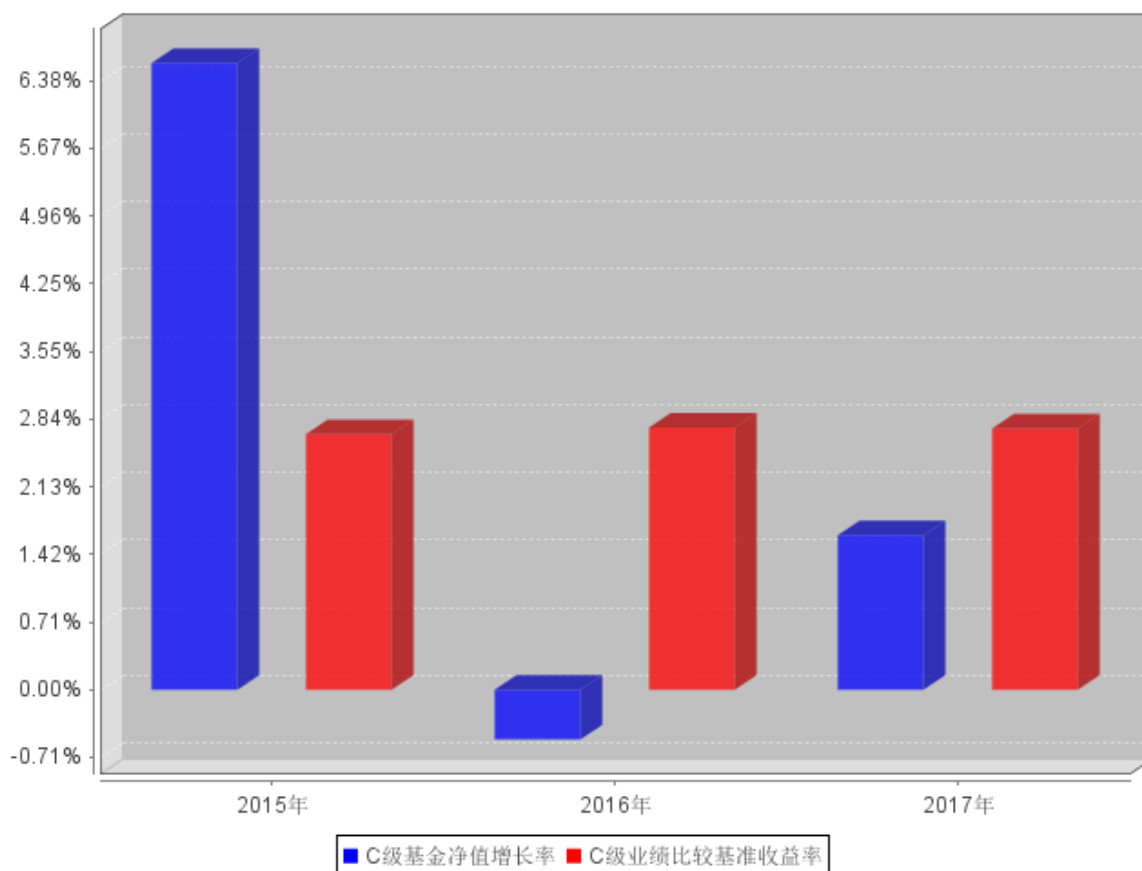
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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、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。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

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
2015	-	-	-	-	
2016	-	-	-	-	
2017	-	-	-	-	
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 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		
余志勇	本基金的基金经理、研究部总监	2015 年 3 月 17 日	-	17	余志勇先生，武汉大学金融学硕士、工商管理学学士，17 年证券投资从业经历，具有证券从业资格，现任融通基金管理有限公司研究部总监。历任湖北省农业厅研究员、闽发证券公司研究员、招商证券股份有限公司研究发展中心研究员。2007 年 4 月加入融通基金管理有限公司，历任研究部行

					业研究员、行业组长，现任融通通泰保本、融通通鑫灵活配置混合、融通新机遇灵活配置混合、融通增裕债券、融通增丰债券、融通通尚灵活配置混合、融通四季添利债券 (LOF)、融通通润债券、融通新动力灵活配置混合基金的基金经理。
王超	本基金的基金经理、固定收益部总监	2016 年 5 月 13 日	-	10	王超先生，金融工程硕士，经济学、数学双学士，10 年证券投资从业经历，具有基金从业资格，现任融通基金管理有限公司固定收益部总监。历任深圳发展银行（现更名为平安银行）债券自营交易盘投资与理财投资管理经理。2012 年 8 月加入融通基金管理有限公司，现任融通可转债债券（由原融通标普中国可转债指数基金转型而来）、融通债券、融通四季添利债券 (LOF)、融通岁岁添利定期开放债券、融通增鑫债券、融通增益债券、融通增裕债券、融通通泰保本、融通增丰债券、融通现金宝货币、融通稳利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 年年初受到央行上调公开市场逆回购利率的影响，债券上涨的势头受到打压，市场持续下跌，随后市场因担忧委外大幅萎缩从而抛售债券，预期过于悲观导致债券收益率大幅攀升。进入下半年，宏观经济表现超出市场预期，社融增量可观，使得经济保持了良好的韧性，而市场原本预计经济将会回落，且这种预期非常顽固，一直延续至三季度；在四季度“十九大”结束时，预期终于彻底被扭转从而导致债券市场在四季度出现大幅下跌。

本基金在年初提高了组合久期和杠杆，随后在一季度末二季度初债券收益率下行时降低了组合久期和杠杆水平，并在 6 月份存单利率上升时提升了存单配置比例和杠杆水平；三季度降低了杠杆；四季度在积累一定收益后适度参与了权益市场投资。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通通泰保本混合 A 基金份额净值为 1.015 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.32%；截至本报告期末融通通泰保本混合 C 基金份额净值为 1.005 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.62%；同期业绩比较基准收益率为 2.74%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为 2017 年金融严监管的指导思想会延续至 2018 年，货币和宏观审慎双支柱政策难有实质性放松。放眼基本面，工业企业利润增速亮眼、PPI 维持高位，导致实际利率较低难以遏制企业融资需求。同时，央行的政策调控更加精准和温和，导致货币政策对实体经济的冲击较小，经济数据的波动性有可能更低，传统的经济周期可能会延长，2018 年的债市难有大

的趋势性机会，需等待实体融资需求下行才能期待市场反转。

#### 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

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 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合规守信、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 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 22325 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：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
<b>资产：</b>		
银行存款	3,862,973.87	4,814,477.03
结算备付金	4,384,298.85	3,552,568.46
存出保证金	43,755.33	50,732.86
交易性金融资产	1,199,956,400.32	1,146,564,555.04
其中：股票投资	130,463,348.62	30,694,359.84
基金投资	-	-
债券投资	1,066,327,051.70	1,099,662,195.20
资产支持证券投资	3,166,000.00	16,208,000.00
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	-	-
应收利息	16,712,218.71	13,581,347.28
应收股利	-	-

应收申购款	-	207.62
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,224,959,647.08	1,168,563,888.29
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2017年12月31日</b>	<b>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	-	-
卖出回购金融资产款	109,679,805.48	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	335,810.18	148,301.61
应付管理人报酬	1,134,654.47	1,204,076.85
应付托管费	189,109.08	200,679.47
应付销售服务费	10,826.32	11,544.55
应付交易费用	161,705.11	46,792.85
应交税费	-	-
应付利息	164,764.92	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	101,024.88	72,263.84
负债合计	111,777,700.44	1,683,659.17
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	875,113,338.02	938,276,360.50
未分配利润	238,068,608.62	228,603,868.62
所有者权益合计	1,113,181,946.64	1,166,880,229.12
负债和所有者权益总计	1,224,959,647.08	1,168,563,888.29

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，融通通泰保本基金份额总额 1,097,362,463.64 份；其中 A 类基金份额净值为 1.015 元，基金份额为 1,076,179,930.49 份；C 类基金份额净值为 1.005 元，基金份额为 21,182,533.15 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：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
<b>一、收入</b>	47,035,520.96	15,092,847.64
1. 利息收入	49,879,383.79	38,343,793.15

其中：存款利息收入	180,412.59	5,199,145.64
债券利息收入	47,008,849.97	31,839,578.78
资产支持证券利息收入	292,840.26	102,186.08
买入返售金融资产收入	2,397,280.97	1,202,882.65
其他利息收入	-	-
2. 投资收益	-18,598,920.82	7,410,460.16
其中：股票投资收益	3,973,197.84	-2,124,291.79
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-23,053,198.26	9,289,627.89
资产支持证券投资收益	-974.90	-220.94
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	482,054.50	245,345.00
3. 公允价值变动收益	15,467,152.70	-30,899,124.62
4. 汇兑收益	-	-
5. 其他收入	287,905.29	237,718.95
<b>减：二、费用</b>	<b>21,405,576.57</b>	<b>22,741,319.03</b>
1. 管理人报酬	13,692,516.02	14,376,894.38
2. 托管费	2,282,086.04	2,396,149.06
3. 销售服务费	126,379.76	3,429,237.87
4. 交易费用	258,410.64	446,721.16
5. 利息支出	4,588,883.54	1,655,132.93
其中：卖出回购金融资产支出	4,588,883.54	1,655,132.93
6. 其他费用	457,300.57	437,183.63
<b>三、利润总额</b>	<b>25,629,944.39</b>	<b>-7,648,471.39</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润</b>	<b>25,629,944.39</b>	<b>-7,648,471.39</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：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)	938,276,360.50	228,603,868.62	1,166,880,229.12
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	25,629,944.39	25,629,944.39



三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-63,163,022.48	-16,165,204.39	-79,328,226.87
其中：1. 基金申购款	1,201,921.41	304,350.40	1,506,271.81
2. 基金赎回款	-64,364,943.89	-16,469,554.79	-80,834,498.68
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）	875,113,338.02	238,068,608.62	1,113,181,946.64
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）	2,235,619,768.47	523,005,394.19	2,758,625,162.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-7,648,471.39	-7,648,471.39
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,297,343,407.97	-286,753,054.18	-1,584,096,462.15
其中：1. 基金申购款	950,478,964.91	239,666,485.72	1,190,145,450.63
2. 基金赎回款	-2,247,822,372.88	-526,419,539.90	-2,774,241,912.78
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）	938,276,360.50	228,603,868.62	1,166,880,229.12

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：

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

#### 7.4 报表附注

##### 7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

###### 7.4.1.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

###### 7.4.1.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

###### 7.4.1.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.2 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
融通基金管理有限公司(“融通基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国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	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

###### 7.4.3.1.1 股票交易

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	-	-	42,198,016.42	15.46%

###### 7.4.3.1.2 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。

###### 7.4.3.1.3 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	-	-	-	-
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	39,298.64	15.64%	-	-

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。

#### 7.4.3.2 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 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	13,692,516.02	14,376,894.38
其中：支付销售机构的客户维护费	1,777,478.58	1,508,608.21

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 1.20% 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。

##### 7.4.3.2.2 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	2,282,086.04	2,396,149.06

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 0.20% 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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

##### 7.4.3.2.3 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 2017年1月1日至2017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	-	126,379.76	126,379.76
合计	-	126,379.76	126,379.76
获得销售服务费的 各关联方名称	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	-	3,429,237.87	3,429,237.87
合计	-	3,429,237.87	3,429,237.87

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，按月支付给融通基金，再由融通基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.60\% \div \text{当年天数}。$$

#### 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

单位：人民币元

本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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	-	50,853,666.44	-	-	-	-
上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	-	-	-	-	-	-

#### 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

本基金本报告期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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

#### 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 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	3,862,973.87	89,766.21	4,814,477.03	388,837.82

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。

#### 7.4.3.6 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。

#### 7.4.3.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 7.4.4 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300664	鹏鹞环保	2017-12-28	2018-1-5	新股未上市	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
002923	润都股份	2017-12-28	2018-1-5	新股未上市	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
603080	新疆火炬	2017-12-25	2018-1-3	新股未上市	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

##### 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
002919	名臣健康	2017-12-28	重大事项	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。

### 7.4.4.3 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

截至本报告期末，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 49,679,805.48 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
111780331	17 广州农村商业银行 CD123	2018-01-04	95.17	540,000	51,391,800.00
合计				540,000	51,391,800.00

#### 7.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 60,000,000.00 元，于 2018 年 1 月 2 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

## § 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	130,463,348.62	10.65
	其中：股票	130,463,348.62	10.65
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,069,493,051.70	87.31
	其中：债券	1,066,327,051.70	87.05
	资产支持证券	3,166,000.00	0.26
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	8,247,272.72	0.67
8	其他各项资产	16,755,974.04	1.37
9	合计	1,224,959,647.08	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末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	635,712.00	0.06
B	采矿业	6,339,047.00	0.57
C	制造业	79,717,483.56	7.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.00
E	建筑业	1,415,934.00	0.13
F	批发和零售业	6,624,187.86	0.60
G	交通运输、仓储和邮政业	1,169,833.94	0.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,000,666.64	0.36
J	金融业	13,725,340.00	1.23
K	房地产业	2,956,065.00	0.27
L	租赁和商务服务业	5,414,985.22	0.49
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	549,544.20	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,500,960.00	0.22
R	文化、体育和娱乐业	5,397,446.00	0.48
S	综合	-	-
	合计	130,463,348.62	11.72

### 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	601888	中国国旅	124,798	5,414,985.22	0.49
2	600887	伊利股份	167,700	5,398,263.00	0.48
3	600276	恒瑞医药	67,800	4,676,844.00	0.42
4	000568	泸州老窖	70,100	4,626,600.00	0.42
5	600801	华新水泥	298,900	4,223,457.00	0.38
6	002343	慈文传媒	117,200	4,173,492.00	0.37
7	600176	中国巨石	253,700	4,132,773.00	0.37
8	601318	中国平安	53,900	3,771,922.00	0.34
9	600031	三一重工	389,500	3,532,765.00	0.32
10	000338	潍柴动力	399,200	3,329,328.00	0.30

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	601888	中国国旅	5,385,933.24	0.46
2	600887	伊利股份	5,020,681.00	0.43
3	600276	恒瑞医药	4,759,839.20	0.41
4	000568	泸州老窖	4,684,378.00	0.40
5	002343	慈文传媒	4,035,699.00	0.35
6	600801	华新水泥	3,887,571.00	0.33
7	601318	中国平安	3,532,687.00	0.30
8	000338	潍柴动力	3,494,883.00	0.30
9	600622	光大嘉宝	3,306,293.70	0.28
10	000063	中兴通讯	3,263,981.00	0.28
11	600176	中国巨石	3,248,354.00	0.28
12	002008	大族激光	3,183,467.00	0.27
13	600031	三一重工	3,108,042.00	0.27
14	002475	立讯精密	3,008,025.00	0.26
15	300136	信维通信	2,978,087.00	0.26
16	600036	招商银行	2,792,829.70	0.24
17	600782	新钢股份	2,784,357.88	0.24
18	002530	丰东股份	2,782,185.00	0.24
19	000651	格力电器	2,730,320.57	0.23
20	600030	中信证券	2,640,300.00	0.23

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	300498	温氏股份	4,167,155.40	0.36
2	002415	海康威视	3,644,229.50	0.31
3	000651	格力电器	3,528,280.00	0.30
4	002475	立讯精密	3,028,622.96	0.26



5	000858	五 粮 液	2,804,859.00	0.24
6	000001	平安银行	2,613,800.00	0.22
7	002142	宁波银行	2,573,004.00	0.22
8	002304	洋河股份	2,480,273.30	0.21
9	600999	招商证券	2,259,464.00	0.19
10	600782	新钢股份	2,164,342.00	0.19
11	000895	双汇发展	2,115,806.00	0.18
12	600498	烽火通信	1,939,561.96	0.17
13	300070	碧水源	1,836,499.00	0.16
14	000166	申万宏源	1,748,300.00	0.15
15	002594	比亚迪	1,715,238.00	0.15
16	002736	国信证券	1,555,443.00	0.13
17	002127	南极电商	1,065,051.00	0.09
18	600809	山西汾酒	1,050,907.67	0.09
19	002322	理工环科	838,890.00	0.07
20	300038	梅泰诺	758,254.00	0.06

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	140,931,889.44
卖出股票收入（成交）总额	49,616,587.25

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	6,989,500.00	0.63
2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,760,000.00	4.47
	其中：政策性金融债	49,760,000.00	4.47
4	企业债券	124,101,400.00	11.15
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	30,287,000.00	2.72
7	可转债（可交换债）	3,205,151.70	0.29
8	同业存单	851,984,000.00	76.54

9	其他	-	-
10	合计	1,066,327,051.70	95.79

#### 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	111719418	17 恒丰银行 CD418	1,000,000	98,710,000.00	8.87
2	111713057	17 浙商银行 CD057	1,000,000	96,450,000.00	8.66
3	111780939	17 南京银行 CD132	1,000,000	96,450,000.00	8.66
4	111780331	17 广州农村商业银行 CD123	800,000	76,136,000.00	6.84
5	170207	17 国开 07	500,000	49,760,000.00	4.47

#### 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1689219	16 丰耀 1A	200,000	3,166,000.00	0.28

#### 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	43,755.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,712,218.71
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,755,974.04

## 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	132007	16 凤凰 EB	2,730,000.00	0.25

## 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## §9 基金份额持有人信息

## 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
融通通泰保本混合 A	2,437	441,600.30	800,548,638.46	74.39%	275,631,292.03	25.61%
融通通泰保本混合 C	1	21,182,533.15	21,182,533.15	100.00%	0.00	0.00%
合计	2,438	450,107.66	821,731,171.61	74.88%	275,631,292.03	25.12%

## 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	127.65	0.0000%
	融通通泰保本混合 C	0.00	0.0000%
	合计	127.65	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	-
本报告期初基金份额总额	1,155,409,046.01	21,182,533.15
本报告期基金总申购份额	1,507,733.13	-
减：本报告期基金总赎回份额	80,736,848.65	-
本报告期末基金份额总额	1,076,179,930.49	21,182,533.15

## § 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 基金管理人的重大人事变动

(1) 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) 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 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 100,000.00 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	
东兴证券	1	75,184,995.12	39.54%	68,516.20	39.17%	-
平安证券	2	61,694,906.54	32.45%	57,453.16	32.84%	-
恒泰证券	1	18,635,477.46	9.80%	17,355.57	9.92%	-
长江证券	1	12,303,926.50	6.47%	11,212.65	6.41%	-
海通证券	1	10,620,824.40	5.59%	9,678.79	5.53%	-
天风证券	2	8,084,712.26	4.25%	7,367.40	4.21%	-
申万宏源	1	2,826,180.00	1.49%	2,632.04	1.50%	-
中泰证券	3	441,594.91	0.23%	402.42	0.23%	-
中金公司	1	174,773.70	0.09%	159.27	0.09%	-
中信证券	1	100,757.17	0.05%	91.82	0.05%	-
安信证券	2	67,458.08	0.04%	61.47	0.04%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-

西部证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	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  
要，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、本基金本报告期内新增 1 个东北证券、2 个天风证券、1 个东兴证券、1 个华安证券、1 个西藏东方财富，减少 2 个中山证券交易单元，其他交易单元均为本基金合同生效时新增。

#### 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	成交金额	占当期债券回购	成交金额	占当期权证

		例		成交总额 的比例		成交总额 的比例
东兴证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	2,483,500,000.00	18.47%	-	-
恒泰证券	66,504,092.73	14.59%	2,404,900,000.00	17.89%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	931,000,000.00	6.93%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	5,126,746.37	1.12%	67,000,000.00	0.50%	-	-
中信证券	13,115,526.70	2.88%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	371,183,617.20	81.41%	7,557,100,000.00	56.21%	-	-

### §12 影响投资者决策的其他重要信息

#### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-20171231	500,492,817.99	-	-	500,492,817.99	45.61%

	2	20170101-20171231	300,055,820.47	-	-	300,055,820.47	27.34%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能存在因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金单位份额净值剧烈波动的风险及流动性风险。							

## 12.2 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 22 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