

融通成长 30 灵活配置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成长 30 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 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       | 融通成长 30 灵活配置混合   |
| 基金主代码      | 002252           |
| 前端交易代码     | 002252           |
| 后端交易代码     | 002253           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2015 年 12 月 11 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 | 209,072,429.73 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期              |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金通过精选个股和集中投资，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的持续稳健增值。   |
| 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、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 12 月 11 日(基) |
|---------------|--------|--------|---------------------|

|               |                |                | 金合同生效日)-2015<br>年 12 月 31 日 |
|---------------|----------------|----------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益       | 18,536,164.89  | -1,840,931.39  | -1,390,552.22               |
| 本期利润          | 23,838,412.18  | -17,465,587.27 | 6,532,898.28                |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0668         | -0.0264        | 0.0074                      |
| 本期基金份额净值增长率   | 5.80%          | -4.17%         | 0.70%                       |
| 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  | 0.0210         | -0.0347        | -0.0016                     |
| 期末基金资产净值      | 213,453,302.68 | 434,729,203.89 | 889,466,734.92              |
| 期末基金份额净值      | 1.021          | 0.965          | 1.007                       |

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）。

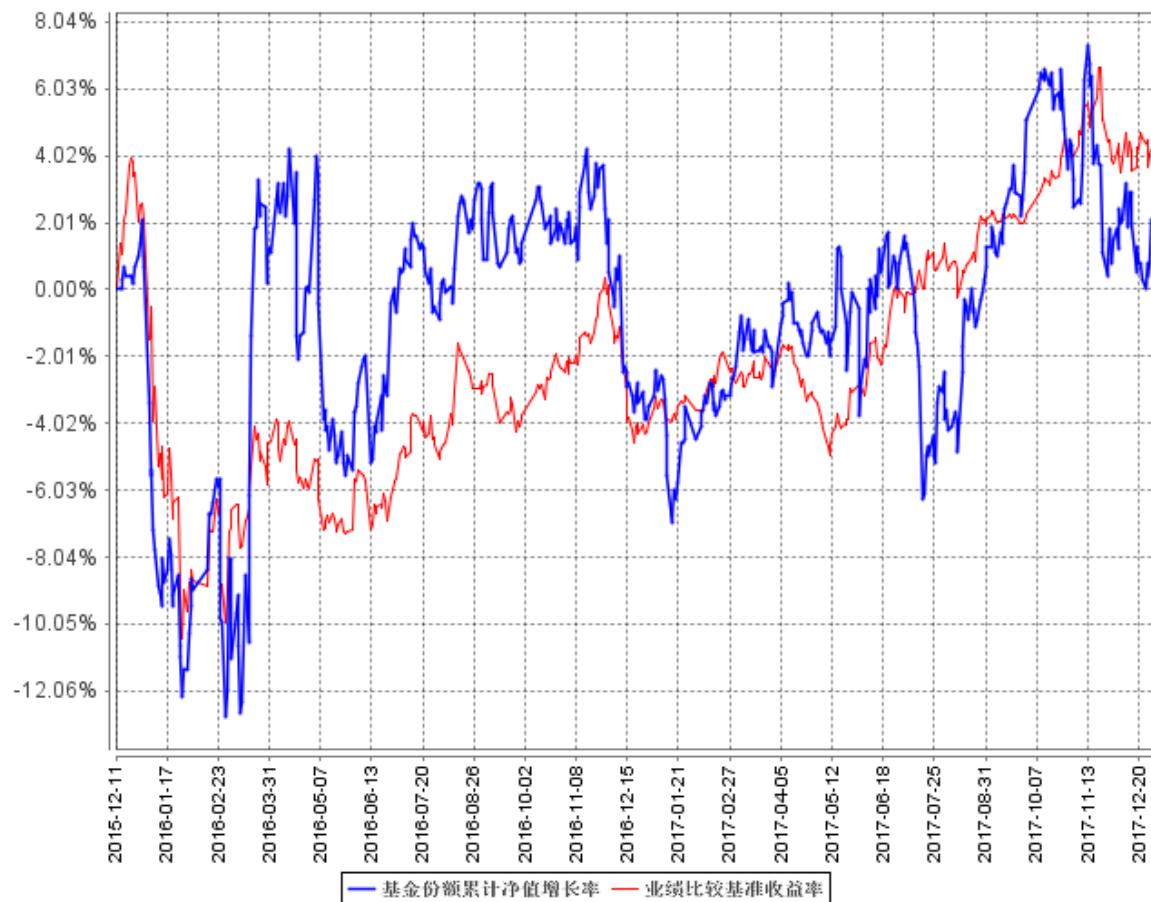
### 3.2 基金净值表现

#### 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      | -2.85%   | 0.86%       | 1.96%      | 0.40%         | -4.81% | 0.46% |
| 过去六个月      | 1.29%    | 0.86%       | 4.25%      | 0.35%         | -2.96% | 0.51% |
| 过去一年       | 5.80%    | 0.81%       | 8.60%      | 0.32%         | -2.80% | 0.49% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.10%    | 1.04%       | 4.24%      | 0.55%         | -2.14% | 0.49% |

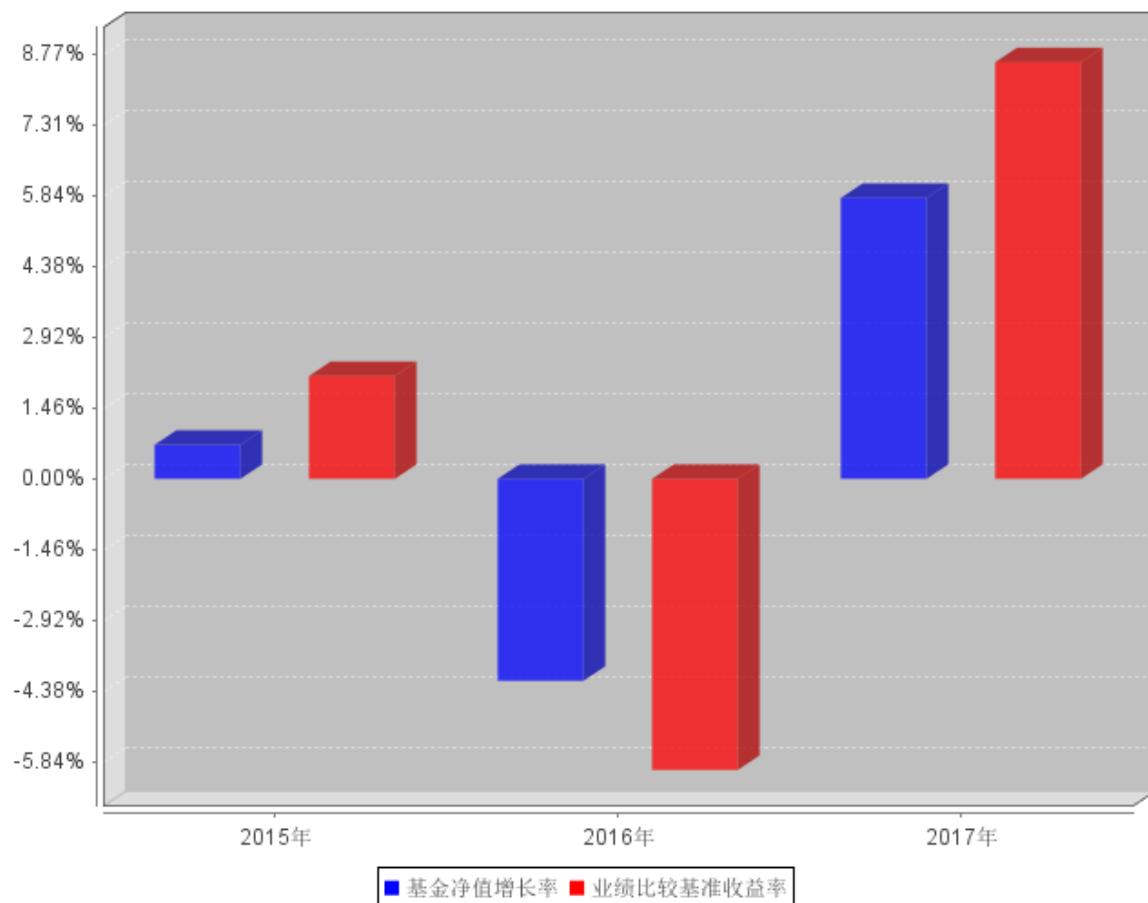
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同生效日为 2015 年 12 月 11 日，合同生效当年按实际存续期计算，未按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度   | 每10份基金份额<br>分红数 | 现金形式发放总<br>额 | 再投资形式发<br>放总额 | 年度利润分配合<br>计 | 备注 |
|------|-----------------|--------------|---------------|--------------|----|
| 2017 | -               | -            | -             | -            | -  |
| 2016 | -               | -            | -             | -            | -  |
| 2015 | -               | -            | -             | -            | -  |
| 合计   | -               | -            | -             | -            | -  |

注：本基金合同生效日为 2015 年 12 月 11 日。

## § 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 AssetManagement 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 |        |   |
| 付伟琦 | 本基金的基金经理、研究部总经理 | 2017 年 2 月 18 日 | -    | 7      | 付伟琦先生，清华大学物理学博士、西安交通大学物理学学士，7 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研究部总经理。历任中信证券公司行业研究员、瑞银证券公司行业研究员。2014 年 11 月加入融通基金管理有限公司，现任融通新能源灵活配置混合、融通内需驱动混合、融通成长 30 灵活配置混合基金的基金经理。 |

|     |          |             |            |   |   |
|-----|----------|-------------|------------|---|---|
| 刘格菘 | 本基金的基金经理 | 2015年12月11日 | 2017年2月18日 | 6 | 刘格菘先生，中国人民银行研究生部经济学博士、金融学硕士，东北财经大学国际金融学士，6年证券投资从业经历，具有基金从业资格，曾任融通基金管理有限公司权益投资部总经理。曾任职于中国人民银行营业管理部，历任中邮创业基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、中邮核心成长股票型证券投资基金的基金经理。2014年9月加入融通基金管理有限公司，曾任融通领先成长混合（LOF）、融通互联网传媒灵活配置混合、融通新区域新经济灵活配置混合、融通成长 30 灵活配置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, 我们重点持有了一批内生增长速度高的成长股, 偏离了市场的主线。大盘蓝筹股估值出现大幅提升, 而成长类个股估值则一直在压缩。但我们认为, 长期而言, 快速有质量的成长才是价值创造的源泉。我们依然青睐内生成长速度快的公司。

##### 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 1.021 元; 本报告期基金份额净值增长率为 5.80%, 业绩比较基准收益率为 8.60%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经过过去两年的去产能、去库存, 叠加全球经济进入复苏周期, 我们认为经济将表现出较好的韧性, 企业盈利仍将保持上升趋势。在这种背景下, 股票市场或将有较好的表现。

2017 年, 市场出现极大的分化, 市场的估值体系发生了较大的转变。A 股市场由来已久的成长溢价, 转变为竞争力溢价, 市场给予各个板块龙头公司显著的估值溢价。我们认为, 这是符合我国经济环境背景的。中国已经走过了快速发展期, 有质量的发展重于数量的扩张。

与此同时, 经过一年多时间的分化, 市场大小股票的估值中枢开始收敛, 白马蓝筹股估值已经高于一批内生增长强劲的中小盘公司。从长期而言, 有质量的增长是价值创造的源泉。对于具备较好增长动力和前景的公司, 是目前最具风险收益比的资产, 我们会继续重点发掘与持有这类公司。

#### 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适用性的情况下及时修订估值方法, 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成长 30 灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，融通成长 30 灵活配置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成长 30 灵活配置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。本报告期内，融通成长 30 灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对融通基金管理有限公司编制和披露的融通成长 30 灵活配置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 22329 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：融通成长 30 灵活配置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<br>2017 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |                         |                          |
| 银行存款       | 25,093,446.19           | 255,052,092.41           |
| 结算备付金      | 1,111,561.82            | 3,883,866.45             |
| 存出保证金      | 230,711.47              | 926,220.15               |
| 交易性金融资产    | 191,052,618.62          | 217,840,883.86           |
| 其中：股票投资    | 191,052,618.62          | 217,840,883.86           |
| 基金投资       | —                       | —                        |
| 债券投资       | —                       | —                        |
| 资产支持证券投资   | —                       | —                        |
| 贵金属投资      | —                       | —                        |
| 衍生金融资产     | —                       | —                        |
| 买入返售金融资产   | —                       | —                        |
| 应收证券清算款    | 814,434.73              | —                        |
| 应收利息       | 7,069.51                | 27,003.53                |
| 应收股利       | —                       | —                        |
| 应收申购款      | 15,127.29               | —                        |
| 递延所得税资产    | —                       | —                        |
| 其他资产       | —                       | —                        |
| 资产总计       | 218,324,969.63          | 477,730,066.40           |
| 负债和所有者权益   | 本期末<br>2017 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日 |
| <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  | —                       | —                        |
| 应付证券清算款    | 3,725,619.55            | 40,562,878.06            |
| 应付赎回款      | 129,526.17              | 123,708.34               |
| 应付管理人报酬    | 273,013.65              | 567,506.13               |
| 应付托管费      | 45,502.28               | 94,584.34                |
| 应付销售服务费    | —                       | —                        |
| 应付交易费用     | 638,005.30              | 1,591,953.10             |
| 应交税费       | —                       | —                        |

|               |                |                |
|---------------|----------------|----------------|
| 应付利息          | -              | -              |
| 应付利润          | -              | -              |
| 递延所得税负债       | -              | -              |
| 其他负债          | 60,000.00      | 60,232.54      |
| 负债合计          | 4,871,666.95   | 43,000,862.51  |
| <b>所有者权益:</b> |                |                |
| 实收基金          | 209,072,429.73 | 450,367,435.46 |
| 未分配利润         | 4,380,872.95   | -15,638,231.57 |
| 所有者权益合计       | 213,453,302.68 | 434,729,203.89 |
| 负债和所有者权益总计    | 218,324,969.63 | 477,730,066.40 |

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.021 元，基金份额总额 209,072,429.73 份。

## 7.2 利润表

会计主体：融通成长 30 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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2016 年 1 月 1 日至 2016<br>年 12 月 31 日 |
|---------------|---|--|
| <b>一、收入</b>   | 36,127,290.92                             | 14,592,075.53                                  |
| 1. 利息收入       | 703,137.85                                | 1,991,401.42                                   |
| 其中：存款利息收入     | 703,137.85                                | 1,991,401.42                                   |
| 债券利息收入        | -   | -  |
| 资产支持证券利息收入    | -   | -  |
| 买入返售金融资产收入    | -   | -  |
| 其他利息收入        | -   | -  |
| 2. 投资收益       | 29,598,757.43                             | 27,395,055.95                                  |
| 其中：股票投资收益     | 28,103,587.89                             | 24,510,424.00                                  |
| 基金投资收益        | -   | -  |
| 债券投资收益        | -   | -  |
| 资产支持证券投资收益    | -   | -  |
| 贵金属投资收益       | -   | -  |
| 衍生工具收益        | -   | -  |
| 股利收益          | 1,495,169.54                              | 2,884,631.95                                   |
| 3. 公允价值变动收益   | 5,302,247.29                              | -15,624,655.88                                 |
| 4. 汇兑收益       | -   | -  |
| 5. 其他收入       | 523,148.35                                | 830,274.04                                     |
| <b>减：二、费用</b> | 12,288,878.74                             | 32,057,662.80                                  |
| 1. 管理人报酬      | 5,342,000.17                              | 9,736,675.25                                   |
| 2. 托管费        | 890,333.29                                | 1,622,779.18                                   |
| 3. 销售服务费      | -   | -  |

|               |                         |                          |
|---------------|-------------------------|--------------------------|
| 4. 交易费用       | 5, 677, 824. 28         | 20, 328, 362. 66         |
| 5. 利息支出       | -                       | -                        |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | -                       | -                        |
| 6. 其他费用       | 378, 721. 00            | 369, 845. 71             |
| <b>三、利润总额</b> | <b>23, 838, 412. 18</b> | <b>-17, 465, 587. 27</b> |
| 减：所得税费用       | -                       | -                        |
| <b>四、净利润</b>  | <b>23, 838, 412. 18</b> | <b>-17, 465, 587. 27</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通成长 30 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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                        | 本期<br>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）           | 450, 367, 435. 46                           | -15, 638, 231. 57 | 434, 729, 203. 89  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）  | -   | 23, 838, 412. 18  | 23, 838, 412. 18   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数      | -241, 295, 005. 73                          | -3, 819, 307. 66  | -245, 114, 313. 39 |
| 其中：1. 基金申购款               | 51, 978, 994. 57                            | 57, 328. 22       | 52, 036, 322. 79   |
| 2. 基金赎回款                  | -293, 274, 000. 30                          | -3, 876, 635. 88  | -297, 150, 636. 18 |
| 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）           | 209, 072, 429. 73                           | 4, 380, 872. 95   | 213, 453, 302. 68  |
| 项目                        | 上年度可比期间<br>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）           | 882, 933, 836. 64                           | 6, 532, 898. 28   | 889, 466, 734. 92  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）  | -   | -17, 465, 587. 27 | -17, 465, 587. 27  |
| 三、本期基金份额交易产               | -432, 566, 401. 18                          | -4, 705, 542. 58  | -437, 271, 943. 76 |

|                           |                 |                |                 |
|---------------------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 生的基金净值变动数                 |                 |                |                 |
| 其中：1. 基金申购款               | 36,015.58       | -4,244.18      | 31,771.40       |
| 2. 基金赎回款                  | -432,602,416.76 | -4,701,298.40  | -437,303,715.16 |
| 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）           | 450,367,435.46  | -15,638,231.57 | 434,729,203.89  |

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

本基金在本报告期内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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |                      | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年12月31日 |                      |
|-------|-----------------------------|----------------------|----------------------------------|----------------------|
|       | 成交金额                        | 占当期股票<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额                             | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 |
| 新时代证券 | 350,475,375.59              | 9.36%                | 1,059,055,873.91                 | 7.88%                |

#### 7.4.3.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 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<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |                |          |                  |
|----------------------------------|-----------------------------|----------------|----------|------------------|
|                                  | 当期<br>佣金                    | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣<br>金总额的比例 |
| 新时代证券                            | 326,396.78                  | 9.48%          | -        | -                |
| 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年12月31日 |                             |                |          |                  |
| 关联方名称                            | 当期<br>佣金                    | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣<br>金总额的比例 |
|                                  | 986,296.66                  | 8.01%          | -        | -                |

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等服务。

#### 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<br>2017年1月1日至2017年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年12月31<br>日 |
|---------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付<br>的管理费  | 5,342,000.17                    | 9,736,675.25                         |
| 其中：支付销售机构的客<br>户维护费 | 2,724,579.75                    | 6,187,499.66                         |

注：1、支付基金管理人融通基金的基金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：

日基金管理人报酬=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。

#### 7.4.3.2.2 基金托管费

| 项目             | 本期<br>2017年1月1日至2017年12月31日 | 单位：人民币元                          |  |
|----------------|-----------------------------|----------------------------------|--|
|                |                             | 上年度可比期间<br>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 | 890,333.29                  | 1,622,779.18                     |  |

注：支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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：

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

#### 7.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

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

本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

本基金本报告期内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

| 关联方<br>名称 | 本期<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |            | 上年度可比期间<br>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       |
|           | 25,093,446.19               | 670,032.82 | 255,052,092.41                   | 1,876,128.60 |

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<br>(单位：<br>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 | -  |

##### 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<br>(股) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
|--------|------|------------|--------|--------|------------|--------|-----------|-----------|-----------|----|
| 300730 | 科创信息 | 2017-12-25 | 重大事项   | 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   | 35.26  | 2018-01-02 | 38.79  | 821       | 10,311.76 | 28,948.46 | -  |
| 000401 | 冀东水泥 | 2017-11-21 | 重大资产重组 | 13.79  | 2018-01-15 | 15.17  | 91        | 1,775.61  | 1,254.89  | -  |

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

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。

###### 7.4.4.3.2 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<br>(%) |
|----|--------|----------------|------------------|
| 1  | 权益投资   | 191,052,618.62 | 87.51            |
|    | 其中：股票  | 191,052,618.62 | 87.51            |
| 2  | 基金投资   | -              | -                |
| 3  | 固定收益投资 | -              | -                |
|    | 其中：债券  | -              | -                |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
|   | 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      | 26,205,008.01  | 12.00  |
| 8 | 其他各项资产            | 1,067,343.00   | 0.49   |
| 9 | 合计                | 218,324,969.63 | 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         | -              | -             |
| B  | 采矿业              | -              | -             |
| C  | 制造业              | 78,681,833.31  | 36.86         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 16,143.20      | 0.01          |
| E  | 建筑业              | -              | -             |
| F  | 批发和零售业           | 35,190,552.51  | 16.49         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 17,957.94      | 0.01          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 23,533,380.30  | 11.03         |
| J  | 金融业              | 15,604,948.72  | 7.31          |
| K  | 房地产业             | 12,481,715.00  | 5.85          |
| 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      | 0.02          |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -             |
| P  | 教育               | -              | -             |
| Q  | 卫生和社会工作          | 8,752,199.04   | 4.10          |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 16,741,565.40  | 7.84          |
| S  | 综合               | -              | -             |
|    | 合计               | 191,052,618.62 | 89.51         |

## 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  | 002640 | 跨境通  | 1,097,816 | 21,012,198.24 | 9.84          |
| 2  | 002832 | 比音勒芬 | 292,100   | 17,581,499.00 | 8.24          |
| 3  | 300365 | 恒华科技 | 545,673   | 17,270,550.45 | 8.09          |

|    |        |      |         |               |      |
|----|--------|------|---------|---------------|------|
| 4  | 300144 | 宋城演艺 | 897,190 | 16,741,565.40 | 7.84 |
| 5  | 603556 | 海兴电力 | 381,065 | 13,870,766.00 | 6.50 |
| 6  | 603328 | 依顿电子 | 852,255 | 12,229,859.25 | 5.73 |
| 7  | 603900 | 莱绅通灵 | 377,173 | 10,934,245.27 | 5.12 |
| 8  | 603737 | 三棵树  | 139,785 | 9,909,358.65  | 4.64 |
| 9  | 603308 | 应流股份 | 554,000 | 8,803,060.00  | 4.12 |
| 10 | 002044 | 美年健康 | 400,192 | 8,752,199.04  | 4.10 |

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  | 002640 | 跨境通  | 58,040,978.62 | 13.35           |
| 2  | 300365 | 恒华科技 | 57,170,588.71 | 13.15           |
| 3  | 600030 | 中信证券 | 47,723,792.50 | 10.98           |
| 4  | 300144 | 宋城演艺 | 42,001,993.19 | 9.66            |
| 5  | 603556 | 海兴电力 | 41,732,118.05 | 9.60            |
| 6  | 600114 | 东睦股份 | 38,477,200.20 | 8.85            |
| 7  | 300203 | 聚光科技 | 37,028,992.79 | 8.52            |
| 8  | 601992 | 金隅股份 | 36,911,092.00 | 8.49            |
| 9  | 603737 | 三棵树  | 36,250,190.87 | 8.34            |
| 10 | 300012 | 华测检测 | 32,192,512.91 | 7.41            |
| 11 | 600029 | 南方航空 | 31,723,241.33 | 7.30            |
| 12 | 002221 | 东华能源 | 31,705,798.26 | 7.29            |
| 13 | 600019 | 宝钢股份 | 30,276,134.00 | 6.96            |
| 14 | 601933 | 永辉超市 | 26,252,258.88 | 6.04            |
| 15 | 300418 | 昆仑万维 | 24,670,568.44 | 5.67            |
| 16 | 603588 | 高能环境 | 24,335,629.90 | 5.60            |
| 17 | 600406 | 国电南瑞 | 23,770,143.10 | 5.47            |
| 18 | 300476 | 胜宏科技 | 21,559,832.85 | 4.96            |
| 19 | 300115 | 长盈精密 | 21,016,819.23 | 4.83            |
| 20 | 600588 | 用友网络 | 20,975,576.41 | 4.82            |
| 21 | 000581 | 威孚高科 | 20,690,867.26 | 4.76            |
| 22 | 600491 | 龙元建设 | 20,395,315.96 | 4.69            |

|    |        |      |                  |       |
|----|--------|------|------------------|-------|
| 23 | 600688 | 上海石化 | 20, 190, 895. 70 | 4. 64 |
| 24 | 002311 | 海大集团 | 18, 376, 332. 36 | 4. 23 |
| 25 | 002048 | 宁波华翔 | 18, 180, 246. 36 | 4. 18 |
| 26 | 002832 | 比音勒芬 | 17, 668, 461. 29 | 4. 06 |
| 27 | 002127 | 南极电商 | 17, 581, 719. 57 | 4. 04 |
| 28 | 600076 | 康欣新材 | 16, 693, 476. 68 | 3. 84 |
| 29 | 603328 | 依顿电子 | 16, 456, 736. 67 | 3. 79 |
| 30 | 601111 | 中国国航 | 16, 138, 815. 00 | 3. 71 |
| 31 | 601233 | 桐昆股份 | 15, 253, 893. 70 | 3. 51 |
| 32 | 000980 | 金马股份 | 15, 216, 741. 50 | 3. 50 |
| 33 | 300244 | 迪安诊断 | 15, 187, 598. 40 | 3. 49 |
| 34 | 601211 | 国泰君安 | 15, 136, 455. 00 | 3. 48 |
| 35 | 000709 | 河钢股份 | 14, 853, 147. 00 | 3. 42 |
| 36 | 300422 | 博世科  | 14, 694, 307. 29 | 3. 38 |
| 37 | 600502 | 安徽水利 | 14, 669, 907. 07 | 3. 37 |
| 38 | 000703 | 恒逸石化 | 14, 548, 399. 57 | 3. 35 |
| 39 | 000550 | 江铃汽车 | 14, 455, 684. 90 | 3. 33 |
| 40 | 002480 | 新筑股份 | 14, 331, 549. 28 | 3. 30 |
| 41 | 600325 | 华发股份 | 13, 874, 055. 60 | 3. 19 |
| 42 | 002690 | 美亚光电 | 13, 636, 089. 85 | 3. 14 |
| 43 | 002044 | 美年健康 | 13, 586, 718. 33 | 3. 13 |
| 44 | 000683 | 远兴能源 | 12, 936, 158. 80 | 2. 98 |
| 45 | 300426 | 唐德影视 | 12, 878, 783. 44 | 2. 96 |
| 46 | 002172 | 澳洋科技 | 12, 843, 493. 18 | 2. 95 |
| 47 | 600005 | 武钢股份 | 12, 830, 590. 00 | 2. 95 |
| 48 | 600782 | 新钢股份 | 12, 826, 190. 00 | 2. 95 |
| 49 | 600497 | 驰宏锌锗 | 12, 805, 571. 76 | 2. 95 |
| 50 | 300408 | 三环集团 | 12, 782, 253. 00 | 2. 94 |
| 51 | 600295 | 鄂尔多斯 | 12, 710, 568. 21 | 2. 92 |
| 52 | 603108 | 润达医疗 | 12, 667, 007. 45 | 2. 91 |
| 53 | 603366 | 日出东方 | 12, 521, 360. 00 | 2. 88 |
| 54 | 603900 | 莱绅通灵 | 12, 018, 906. 65 | 2. 76 |
| 55 | 000860 | 顺鑫农业 | 11, 924, 038. 41 | 2. 74 |
| 56 | 000878 | 云南铜业 | 11, 919, 339. 25 | 2. 74 |
| 57 | 000725 | 京东方A | 11, 825, 102. 00 | 2. 72 |
| 58 | 600507 | 方大特钢 | 11, 431, 292. 22 | 2. 63 |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 59 | 002583 | 海能达  | 11,019,864.93 | 2.53 |
| 60 | 603308 | 应流股份 | 10,793,088.20 | 2.48 |
| 61 | 300033 | 同花顺  | 10,520,571.93 | 2.42 |
| 62 | 000401 | 冀东水泥 | 10,121,217.07 | 2.33 |
| 63 | 600420 | 现代制药 | 10,026,246.00 | 2.31 |
| 64 | 002542 | 中化岩土 | 9,772,470.00  | 2.25 |
| 65 | 002661 | 克明面业 | 9,525,388.77  | 2.19 |
| 66 | 601000 | 唐山港  | 9,392,453.00  | 2.16 |
| 67 | 002463 | 沪电股份 | 9,373,908.68  | 2.16 |
| 68 | 601766 | 中国中车 | 8,966,534.00  | 2.06 |
| 69 | 601939 | 建设银行 | 8,866,822.64  | 2.04 |

注：“买入金额”是指买入股票成交金额，即成交单价乘以成交量，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  | 002640 | 跨境通  | 43,775,097.46 | 10.07           |
| 2  | 600030 | 中信证券 | 43,349,099.00 | 9.97            |
| 3  | 600114 | 东睦股份 | 40,063,955.58 | 9.22            |
| 4  | 601992 | 金隅股份 | 38,030,004.56 | 8.75            |
| 5  | 603011 | 合锻智能 | 37,989,762.76 | 8.74            |
| 6  | 300203 | 聚光科技 | 37,527,281.13 | 8.63            |
| 7  | 300365 | 恒华科技 | 37,332,848.56 | 8.59            |
| 8  | 600029 | 南方航空 | 34,138,434.81 | 7.85            |
| 9  | 600019 | 宝钢股份 | 33,104,200.00 | 7.61            |
| 10 | 002322 | 理工环科 | 32,756,569.31 | 7.53            |
| 11 | 300012 | 华测检测 | 32,606,401.38 | 7.50            |
| 12 | 002221 | 东华能源 | 31,725,005.00 | 7.30            |
| 13 | 601933 | 永辉超市 | 29,942,016.90 | 6.89            |
| 14 | 603737 | 三棵树  | 28,920,521.70 | 6.65            |
| 15 | 600406 | 国电南瑞 | 27,107,001.62 | 6.24            |
| 16 | 300426 | 唐德影视 | 26,624,849.89 | 6.12            |
| 17 | 603588 | 高能环境 | 25,997,805.89 | 5.98            |
| 18 | 603556 | 海兴电力 | 23,759,438.44 | 5.47            |
| 19 | 300144 | 宋城演艺 | 23,697,817.53 | 5.45            |
| 20 | 000687 | 华讯方舟 | 23,567,102.05 | 5.42            |
| 21 | 300418 | 昆仑万维 | 23,027,650.91 | 5.30            |

|    |        |       |               |      |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 22 | 600491 | 龙元建设  | 22,094,443.85 | 5.08 |
| 23 | 600519 | 贵州茅台  | 21,688,503.15 | 4.99 |
| 24 | 300476 | 胜宏科技  | 21,505,509.21 | 4.95 |
| 25 | 000581 | 威孚高科  | 21,471,962.00 | 4.94 |
| 26 | 002311 | 海大集团  | 20,625,763.75 | 4.74 |
| 27 | 002127 | 南极电商  | 20,497,718.00 | 4.72 |
| 28 | 600688 | 上海石化  | 20,406,586.81 | 4.69 |
| 29 | 300115 | 长盈精密  | 19,622,746.37 | 4.51 |
| 30 | 002048 | 宁波华翔  | 19,133,263.40 | 4.40 |
| 31 | 300316 | 晶盛机电  | 17,682,727.74 | 4.07 |
| 32 | 000980 | 金马股份  | 17,530,259.56 | 4.03 |
| 33 | 601111 | 中国国航  | 16,634,690.00 | 3.83 |
| 34 | 600076 | 康欣新材  | 16,506,106.96 | 3.80 |
| 35 | 000709 | 河钢股份  | 16,372,241.00 | 3.77 |
| 36 | 600588 | 用友网络  | 16,086,923.00 | 3.70 |
| 37 | 300422 | 博世科   | 15,736,519.40 | 3.62 |
| 38 | 601211 | 国泰君安  | 15,339,249.15 | 3.53 |
| 39 | 002488 | 金固股份  | 14,676,239.00 | 3.38 |
| 40 | 601233 | 桐昆股份  | 14,338,619.86 | 3.30 |
| 41 | 002480 | 新筑股份  | 14,236,235.19 | 3.27 |
| 42 | 600325 | 华发股份  | 14,044,346.43 | 3.23 |
| 43 | 000878 | 云南铜业  | 13,982,429.84 | 3.22 |
| 44 | 600502 | 安徽水利  | 13,973,692.12 | 3.21 |
| 45 | 002690 | 美亚光电  | 13,850,346.76 | 3.19 |
| 46 | 000703 | 恒逸石化  | 13,710,025.81 | 3.15 |
| 47 | 000550 | 江铃汽车  | 13,626,601.65 | 3.13 |
| 48 | 600160 | 巨化股份  | 13,526,994.94 | 3.11 |
| 49 | 600782 | 新钢股份  | 13,299,032.00 | 3.06 |
| 50 | 600497 | 驰宏锌锗  | 13,241,868.42 | 3.05 |
| 51 | 600019 | 宝钢股份  | 12,985,000.00 | 2.99 |
| 52 | 300244 | 迪安诊断  | 12,886,704.00 | 2.96 |
| 53 | 600809 | 山西汾酒  | 12,698,821.52 | 2.92 |
| 54 | 603108 | 润达医疗  | 12,671,133.80 | 2.91 |
| 55 | 600295 | 鄂尔多斯  | 12,405,620.54 | 2.85 |
| 56 | 000725 | 京东方 A | 12,374,739.00 | 2.85 |
| 57 | 600507 | 方大特钢  | 12,236,793.30 | 2.81 |
| 58 | 000683 | 远兴能源  | 12,149,441.80 | 2.79 |
| 59 | 002568 | 百润股份  | 11,983,996.70 | 2.76 |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 60 | 002172 | 澳洋科技 | 11,862,596.97 | 2.73 |
| 61 | 002583 | 海能达  | 11,784,942.00 | 2.71 |
| 62 | 000860 | 顺鑫农业 | 11,781,331.95 | 2.71 |
| 63 | 600715 | 文投控股 | 11,006,448.66 | 2.53 |
| 64 | 000401 | 冀东水泥 | 10,612,901.00 | 2.44 |
| 65 | 601766 | 中国中车 | 9,694,941.10  | 2.23 |
| 66 | 601000 | 唐山港  | 9,638,548.00  | 2.22 |
| 67 | 600420 | 现代制药 | 9,581,380.48  | 2.20 |
| 68 | 603366 | 日出东方 | 9,524,070.00  | 2.19 |
| 69 | 002294 | 信立泰  | 9,326,143.95  | 2.15 |
| 70 | 002542 | 中化岩土 | 9,239,968.00  | 2.13 |
| 71 | 300033 | 同花顺  | 9,067,247.50  | 2.09 |
| 72 | 300658 | 延江股份 | 9,059,271.70  | 2.08 |
| 73 | 002463 | 沪电股份 | 8,701,345.79  | 2.00 |
| 74 | 002661 | 克明面业 | 8,699,298.78  | 2.00 |

注：“卖出金额”是指卖出股票成交金额，即成交单价乘以成交量，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 | 1,857,224,832.37 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,917,418,932.79 |

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量，相关交易费用不考虑。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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中报告期内无发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。**

依顿电子：

2017 年 1 月 5 日，广东依顿电子科技股份有限公司公告收到中山市环境保护局（以下简称“中山市环保局”）《行政处罚告知书》（中环罚告字[2016]第 239 号），相关情况如下：中山市环保局于 2016 年 5 月 26 日对公司排放口外排的废水进行执法性采样监测。监测结果显示，公司排放的废水中总磷、总氮浓度为 1.38mg/L、31.4mg/L，分别超过了公司持有的《广东省污染物排放许可证》中规定的排放限值 0.38 倍、0.57 倍。

公司以上行为违反了《广东省环境保护条例》第二十一条第一款关于按照排污许可证规定排污的规定。中山市环保局依据《广东省环境保护条例》第六十六条第一款的规定：拟对公司罚款人民币十四万元。

本管理人认为，以上处罚对依顿电子经营影响较小，并且依顿电子已经改正。基于依顿电子业务的发展，本管理人认为依顿电子的业绩有较好的成长性，同时估值处于较低的水平，可以继续持有。

### **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   | 230,711.47   |
| 2  | 应收证券清算款 | 814,434.73   |
| 3  | 应收股利    | —            |
| 4  | 应收利息    | 7,069.51     |
| 5  | 应收申购款   | 15,127.29    |
| 6  | 其他应收款   | —            |
| 7  | 待摊费用    | —            |
| 8  | 其他      | —            |
| 9  | 合计      | 1,067,343.00 |

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### § 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额           | 占总份<br>额比例 |
| 2,729        | 76,611.37     | 19,763.90 | 0.01%      | 209,052,665.83 | 99.99%     |

#### 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 | 187,973.46 | 0.0899%  |

#### 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                 |

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |                |
|----------------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2015年12月11日)基金份额总额 | 882,933,836.64 |
| 本报告期期初基金份额总额               | 450,367,435.46 |
| 本报告期基金总申购份额                | 51,978,994.57  |
| 减:本报告期基金总赎回份额              | 293,274,000.30 |

|              |                |
|--------------|----------------|
| 本报告期期末基金份额总额 | 209,072,429.73 |
|--------------|----------------|

## § 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

本报告期内没有涉及基金管理人、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），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 60,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的基金管理人、托管人的托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易<br>单元 | 股票交易 |       | 应支付该券商的佣金 |       | 备注 |
|------|----------|------|-------|-----------|-------|----|
|      |          | 成交金额 | 占当期股票 | 佣金        | 占当期佣金 |    |
|      |          |      |       |           |       |    |

|        | 数量 |                | 成交总额的比例 |            | 总量的比例  |   |
|--------|----|----------------|---------|------------|--------|---|
| 长江证券   | 1  | 425,947,048.63 | 11.38%  | 388,165.59 | 11.28% | - |
| 恒泰证券   | 1  | 419,937,523.70 | 11.22%  | 391,096.03 | 11.36% | - |
| 中信建投   | 1  | 413,857,943.34 | 11.06%  | 385,423.53 | 11.20% | - |
| 新时代证券  | 1  | 350,475,375.59 | 9.36%   | 326,396.78 | 9.48%  | - |
| 中金公司   | 1  | 341,270,755.30 | 9.12%   | 311,000.61 | 9.04%  | - |
| 安信证券   | 2  | 319,438,025.82 | 8.53%   | 294,111.47 | 8.55%  | - |
| 平安证券   | 2  | 299,379,357.39 | 8.00%   | 276,346.46 | 8.03%  | - |
| 中信证券   | 1  | 230,626,316.68 | 6.16%   | 210,171.79 | 6.11%  | - |
| 天风证券   | 2  | 214,719,310.78 | 5.74%   | 195,677.12 | 5.69%  | - |
| 华泰证券   | 1  | 206,505,689.72 | 5.52%   | 188,189.47 | 5.47%  | - |
| 中泰证券   | 3  | 205,683,607.28 | 5.50%   | 187,442.52 | 5.45%  | - |
| 长城证券   | 1  | 134,320,903.05 | 3.59%   | 122,406.25 | 3.56%  | - |
| 东北证券   | 1  | 74,276,874.12  | 1.98%   | 67,695.09  | 1.97%  | - |
| 东兴证券   | 1  | 61,183,041.86  | 1.63%   | 55,756.42  | 1.62%  | - |
| 申万宏源   | 2  | 45,256,613.28  | 1.21%   | 41,453.42  | 1.20%  | - |
| 华西证券   | 1  | -              | -       | -          | -      | - |
| 华鑫证券   | 1  | -              | -       | -          | -      | - |
| 西部证券   | 1  | -              | -       | -          | -      | - |
| 浙商证券   | 2  | -              | -       | -          | -      | - |
| 光大证券   | 1  | -              | -       | -          | -      | - |
| 广州证券   | 2  | -              | -       | -          | -      | - |
| 国联证券   | 1  | -              | -       | -          | -      | - |
| 海通证券   | 1  | -              | -       | -          | -      | - |
| 渤海证券   | 1  | -              | -       | -          | -      | - |
| 华安证券   | 1  | -              | -       | -          | -      | - |
| 西藏东方财富 | 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

本报告期内基金新增天风证券上海席位和深圳席位各一个，东北证券上海席位一个，东兴证券深圳席位一个，华安证券深圳席位一个，西藏东方财富深圳席位一个。本报告期内基金终止中山证券上海席位和深圳席位各一个。

#### **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**

本基金本报告期无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

### **§ 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 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