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:2016年3月30日

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

【2015】年度报告摘要

§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")2015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2016年3月24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2015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	727,608,777.88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。

注:本基金自2015年10月1日起使用新的业绩比较基准:沪深300指数收益率×75%+中债综合全价(总值)指数收益率×25%。详见本基金管理人于2015年11月11日发布的《融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金变更业绩比较基准及修改相关基金合同的公告》。

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	徐卫东	洪渊
	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	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	479,139,051.09	455,585,078.50	196,975,568.15
本期利润	479,923,232.83	465,768,351.48	113,680,112.89
加权平均基金份额本期利润	0.4770	0.3369	0.0720
本期基金份额净值增长率	32.90%	35.67%	7.00%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.4344	0.3834	0.0702
期末基金资产净值	1,043,681,825.35	1,659,790,094.30	1,558,881,869.45
期末基金份额净值	1.434	1.383	1.070

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。

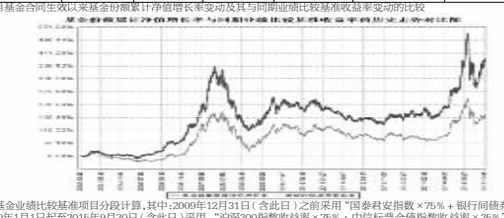
3.期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配利润:如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

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

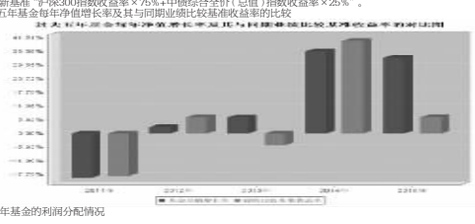
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	23.94%	1.70%	12.81%	1.25%	11.13%	0.45%
过去六个月	1.13%	2.14%	-11.17%	2.01%	12.30%	0.13%
过去一年	32.90%	2.04%	7.08%	1.87%	25.82%	0.17%
过去三年	92.91%	1.49%	42.68%	1.35%	50.23%	0.14%
过去五年	60.68%	1.27%	24.72%	1.21%	35.96%	0.06%
自基金合同生效起至今	405.23%	1.31%	169.20%	1.37%	236.03%	-0.06%

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



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%"。

3.2.3 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



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
2015	3.000	439,645,570.32	217,655,937.30	657,301,507.62	-
2014	0.500	27,414,855.84	45,044,821.53	72,459,677.37	-
2013	0.030	1,886,045.64	3,137,118.70	5,023,164.34	-
合计	3.530	468,946,471.80	265,837,877.53	734,784,349.33	-

§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2015年12月31日,公司管理的基金共有三十七只:一只封闭式基金,即融通通乾封闭基金;三十六只开放式基金,即融通新蓝筹混合基金、融通债券基金、融通深证100指数基金、融通蓝筹成长混合基金、融通行业景气混合基金、融通巨潮100指数基金(LOF)、融通易支付货币基金、融通动力先锋股票基金、融通领先成长混合基金(LOF)、融通内需驱动混合基金、融通深证成份指数基金、融通四季添利债券基金、融通创业板指数基金、融通医疗保健混合基金、融通岁岁添利定期开放债券基金、融通丰利四分法(ODII-FOF)基金、融通七天理财债券基金、融通标普中国可转债指数增强基金、融通通泰保本混合基金、融通通沪融合基金、融通通福分级债券基金、融通通源短融债券基金、融通通债券基金、融通月月添利基金、融通通利证券投资基金、融通通盛稳健产业混合基金、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、融通农业分级指数基金、融通跨界成长混合基金、融通新机遇混合基金和融通成长30混合基金。其中,融通债券基金、融通深证100指数基金和融通蓝筹成长混合基金回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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
薛冀颖	本基金的基金经理	2015-06-19	-	4	工学博士,毕业于清华大学,4年证券从业经验,具有基金从业资格。2011年6月至2014年9月在鹏华基金管理有限公司任研究员。2014年9月加入融通基金管理有限公司任TMT研究组长。
严菲	本基金的基金经理、融通行业景气混合基金基金经理	2007-03-02	2015-06-19	11	经济学硕士,具有证券从业资格。曾先后就职于日盛嘉富证券国际上海代表处、红塔证券从事证券研究工作。2006年7月加入融通基金管理有限公司任行业研究员。

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。

本基金管理人对投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

2015年市场经历了大幅波动,经历上半年大幅上涨的单边行情后随即出现了断崖式下跌,四季度又迎来一波明显的反弹。本基金上半年因蓝筹股配置偏多,净值表现相比同类基金排名靠后,下半年因仓位和结构的调整,在同类基金中的排名中有一定提升,主要在于从6月份下旬开始明显降低仓位,因当时市场情绪已经较为不理性,较多质地较差的公司股价也出现较大幅度上涨,市场累积的风险在加大,7月初市场开始反弹,但本基金认为市场经过大跌之后市场风险偏好大幅下降,上半年大涨的逻辑在很大程度上受到被坏,市场较多公司面临较大幅度的下跌空间,因此本基金谨慎参与反弹,之后市场迎来了第二波下跌,在此下跌过程中本基金跌幅相对较小。四季度本基金在仓位上较三季度有一定增加,主要在于认为在市场第二波杀跌的过程中,市场过度恐慌,而且经过两轮大跌,短期继续下跌的动能相对有限,值得参与反弹。同时出于对市场随时有再次下跌风险的考虑,因此在仓位上也有所控制,不过持仓结构上与上半年有较大改变,以TMT等成长股为主,基本契合了当时的市场风格。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金份额净值增长率为32.90%,业绩比较基准收益率为7.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前整体宏观经济面临一定压力,并且在经历15年年中以来市场几次大幅下跌后,市场风险偏好显著下降,市场信心的恢复需要一个过程,预计短期内很难再出现15年上半年的行情,并且过去几年不少公司的涨幅透支了未来过高的预期,但基本面并没有足够支撑,从目前时点来看未来依然面临一定的下跌空间。在目前市场对公司估值体系已经趋于理性的情况下,未来个股分化会加大,选股会更加可贵。不过目前市场从相比之前高点有较大跌幅,风险已释放较多,在一些景气度相对较高的细分领域,其中优质个股长期来看目前时点具备了一定投资价值,蓝筹成长类股会延续之前的风格,挖掘有发展潜力的行业和细分领域,在此基础上通过深入的调研筛选出优质的公司进行配置,并且以绝对收益思路注重回撤风险。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金的估值业务严格按照《融通基金管理有限公司证券投资基金估值业务原则和程序》进行,公司设立由研究部、风险管理部、登记清算部、固定收益部、国际业务部和监察稽核部共同组成的估值委员会,通过参考行业协会估值意见,参考独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合,减少或避免估值偏差的发生。估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历,估值委员会成员不包含基金经理。

估值委员会定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价,在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法,以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经公司总经理办公会议审批后方可实施。基金在采用新投资策略或投资新品种时,应评价现有估值政策和程序的适用性,其中研究部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价,金融工程小组负责估值方法的研究、价格的计算及复核,登记清算部进行具体的估值核算并计算每日基金净值,每日对基金所投资品种的公开信息、基金会计估值方法的法规等进行搜集并整理汇总,供估值委员会参考,监察稽核部负责基金估值业务的事前、事中及事后的审核工作。基金经理不参与估值决定,参与估值流程各方之间亦不存在任何重大利益冲突,截至报告期末公司未与外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1.本基金管理人于2015年1月21日实施利润分配,以2014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3.00元;

2.本基金管理人于2016年1月18日实施利润分配,以2015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0.1元。

§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657,301,507.62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2015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2015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(2016)第21160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:融通蓝筹成长证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产:		
银行存款	109,203,027.58	79,003,108.39
结算备付金	3,595,269.39	8,728,255.54
存出保证金	1,291,688.55	1,363,087.97
交易性金融资产	905,064,181.60	1,601,351,788.65
其中:股票投资	652,805,253.00	1,237,920,403.65
基金投资	-	-
债券投资	252,258,928.60	363,431,385.00
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	43,523,962.13	-
应收利息	8,045,055.04	9,037,823.57
应收股利	-	-
应收申购款	160,468.55	2,442,863.33
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,067,883,652.84	1,701,926,927.45

负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014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	16,891,260.40	24,749,868.19
应付赎回款	1,333,488.38	6,975,891.76
应付管理人报酬	1,323,925.15	2,095,662.52
应付托管费	220,654.18	349,277.07
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,336,695.13	5,862,539.82
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	846,604.25	854,393.79
负债合计	24,201,827.49	42,136,833.15
所有者权益:		
实收基金	727,608,777.88	1,199,762,383.52
未分配利润	316,073,047.47	460,027,710.78
所有者权益合计	1,043,681,825.35	1,659,790,094.30
负债和所有者权益总计	1,067,883,652.84	1,701,926,927.45

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.434元,基金份额总额727,608,777.88份。

7.2 利润表

会计主体:融通蓝筹成长证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	528,229,256.81	512,568,854.36
1.利息收入	13,535,871.54	17,042,457.44
其中:存款利息收入	1,031,605.24	920,791.95
债券利息收入	12,504,266.30	15,682,195.48
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	439,470.01
其他利息收入	-	-
2.投资收益	512,808,506.45	485,301,277.64
其中:股票投资收益	502,035,500.56	476,543,735.87
基金投资收益	-	-
债券投资收益	3,882,403.02	-234,768.32
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	6,890,602.87	8,992,310.09
3.公允价值变动收益	784,181.74	10,183,272.98
4.汇兑收益	-	-
5.其他收入	1,100,697.08	41,846.30
减:二、费用	48,306,023.98	46,800,502.88
1.管理人报酬	19,889,427.52	22,217,673.46
2.托管费	3,314,904.62	3,702,945.60
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	24,885,961.94	20,606,614.72
5.利息支出	4,094.44	36,692.77
其中:卖出回购金融资产支出	4,094.44	36,692.77
6.其他费用	211,635.46	236,576.33
三、利润总额	479,923,232.83	465,768,351.48
减:所得税费用	-	-
四、净利润	479,923,232.83	465,768,351.48

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:融通蓝筹成长证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,199,762,383.52	460,027,710.78	1,659,790,094.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	479,923,232.83	479,923,232.83
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-472,153,605.64	33,423,611.48	-438,729,994.16
其中:1.基金申购款	1,354,707,055.22	486,204,783.61	1,840,911,838.83
2.基金赎回款	-1,826,860,660.86	-452,781,172.13	-2,279,641,832.99
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-657,301,507.62	-657,301,507.62
五、期末所有者权益(基金净值)	727,608,777.88	316,073,047.47	1,043,681,825.35
	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
项目	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)	1,456,626,891.70	102,254,977.75	1,558,881,869.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	465,768,351.48	465,768,351.48
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-256,864,508.18	-35,535,941.08	-292,400,449.26
其中:1.基金申购款	152,420,824.16	17,344,894.32	169,765,718.48
2.基金赎回款	-409,285,332.34	-52,880,835.40	-462,166,167.74
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-72,459,677.37	-72,459,677.37
五、期末所有者权益(基金净值)	1,199,762,383.52	460,027,710.78	1,659,790,094.30

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:

基金管理公司负责人:孟朝霞　主管会计工作负责人:颜锡廉　会计机构负责人:刘美丽

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

本基金本报告期内无会计政策变更。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.1.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无重大会计差错内容和更正金额。

7.4.2 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
融通基金管理有限公司	基金管理人、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、基金代销机构
新时代证券股份有限公司("新时代证券")	基金管理人股东、基金代销机构
日兴资产管理有限公司	基金管理人股东
深圳市融通资本财富管理有限公司	基金管理人的子公司
融通国际资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.3.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	3,367,343,083.85	20.89%	1,366,037,718.40	10.14%

7.4.3.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间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 2015年1月1日至2015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	3,005,925.20	20.65%	435,281.75	18.65%
	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			
关联方名称	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	1,208,808.13	9.98%	252,582.45	4.31%

注:1.上述佣金按市场佣金率计算,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。权证交易不计佣金。

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 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	19,889,427.52	22,217,673.46
其中:支付销售机构的客户维护费	2,303,604.04	2,705,776.95

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。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,314,904.62	3,702,945.60

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。

7.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均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

份额单位:份

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
基金合同生效日持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	3,828,205.24	-
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	3,828,205.24	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.53%	-

注:"买入金额"是指买出股票成交金额,即成交单价乘以成交数量,相关交易费用不考虑。

1.1.1 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	7,516,562,246.83
卖出股票收入(成交)总额	8,603,814,671.70

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。

1.2 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	99,731,928.60	9.56
2	央行票据	-	-
3	金融债券	152,527,000.00	14.61
	其中:政策性金融债	152,527,000.00	14.61
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	252,258,928.60	24.17

1.3 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	019509	15国债09	995,130	99,731,928.60	9.56
2	150419	15农发19	600,000	60,114,000.00	5.76
3	150413	15农发13	300,000	30,033,000.00	2.88
4	150210	15国开10	200,000	21,672,000.00	2.08
5	140201	14国开01	200,000	20,636,000.00	1.98

1.4 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。

1.5 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。

1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

1.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.7.1 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。

1.7.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

1.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1.8.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

1.8.2 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。

1.8.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

1.9 投资组合报告附注

1.9.1 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。

1.9.2 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。

1.9.3 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	1,291,688.55
2	应收证券清算款	43,523,962.13
3	应收股利	-
4	应收利息	8,045,055.04
5	应收申购款	160,468.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	50,021,174.27

1.9.4 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。

1.9.5 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。

§2 基金份额持有人信息

2.1 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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
42,107	17,280.00	7,012,367.94	0.96%	720,596,409.94	99.04%

2.2 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	7,391.36	0.0010%

2.3 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

§3 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	1,199,762,383.52
本报告期基金总申购份额	1,354,707,055.22
减;本报告期基金总赎回份额	1,826,860,660.86
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	727,608,777.88

§4 重大事件揭示

4.1 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。

4.2 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

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。

4.3 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。

4.4 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。

4.5 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90,000.00元。

4.6 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。

4.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

4.7.1 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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
招商证券	2	5,972,316,279.79	37.05%	5,379,311.22	36.96%	-
新时代证券	1	3,367,343,083.85	20.89%	3,005,925.20	20.65%	-
东兴证券	1	1,791,260,540.07	11.11%	1,655,588.81	11.38%	-
华泰证券	1	1,765,080,820.55	10.95%	1,571,842.26	10.80%	-
中信建投	1	1,351,505,433.08	8.38%	1,232,873.71	8.47%	-
海通证券	1	1,340,188,858.35	8.31%	1,220,105.50	8.38%	-
中金公司