通乾证券投资基金

2015 年度报告摘要

基金管理人:融通基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2016年3月30日

§1 重要提示

1.1 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据通乾证券投资基金(以下简称"本基金")基金合同规定,于2016年3月18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日31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	融通通乾封闭
基金主代码	500038
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2001年8月29日
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,000,000,000.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2001年9月21日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金属于价值成长型基金,主要投资于具有一定竞争优势、业绩能够持续增长或具有增长潜力的成长型上市公司股票,同时兼顾价值型公司股票。通过组合投资,在有效分散和控制风险的前提下,谋求基金资产的稳定增长。
投资策略	以价值成长型投资为主导,把企业的内在价值和未来成长能力作为选择投资对象的最核心标准。重视对趋势的把握,顺势而为,灵活操作。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		融通基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐卫东	田青
	联系电话	(0755)26948666	(010)67595096
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-883-8088,(0755)26948088	(010)67595096
传真		(0755)26935005	(010)66275853

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、上海证券交易所

§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	1,206,927,287.11	418,150,644.78	205,558,703.20
本期利润	490,852,041.05	1,053,995,582.45	211,674,641.07
加权平均基金份额本期利润	0.2454	0.5270	0.1058
本期基金份额净值增长率	18.01%	47.59%	10.31%
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	0.6149	0.2114	0.0273
期末基金资产净值	3,358,135,929.83	3,267,283,888.78	2,263,288,309.77
期末基金份额净值	1.6791	1.6336	1.1316

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;

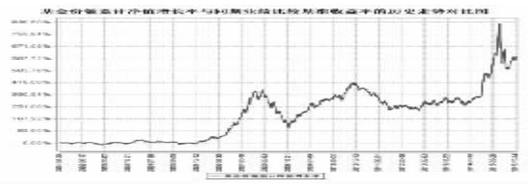
(3)期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配利润:如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

3.2 基金净值表现

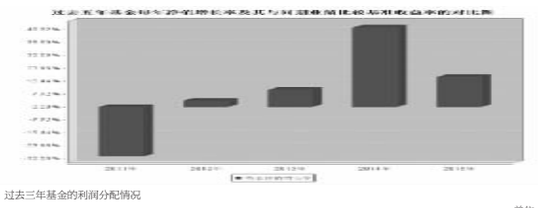
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	11.53%	2.13%	-	-	-	-
过去六个月	-8.50%	4.75%	-	-	-	-
过去一年	18.01%	4.52%	-	-	-	-
过去三年	92.13%	3.39%	-	-	-	-
过去五年	40.39%	2.95%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	591.83%	2.90%	-	-	-	-

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



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	2.0000	400,000,000.00	-	400,000,000.00	
2014	0.2500	50,000,003.44	-	50,000,003.44	
2013	-	-	-	-	
合计	2.2500	450,000,003.44	-	450,000,003.44	

§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(QDII-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、融通通泽混合基金、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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
郭鹏	本基金的基金经理	2015年1月6日	-	9	经济学硕士,具有基金从业资格。2006年4月至2007年12月,在渤海证券从事证券研究工作;2007年12月至2010年4月,在新华资产管理股份有限公司,从事证券研究和投资工作;2010年4月至2012年9月,在宏源证券从事证券投资工作;2012年9月至2014年9月,在齐鲁证券有限公司北京证券资产管理分公司,任执行总经理;2014年10月加入融通基金管理有限公司,从事研究工作。
张延闽	本基金、融通转型三动力灵活配置混合的基金经理	2014年10月25日	-	5	硕士,具有基金从业资格。2010年1月至今,就职于融通基金管理有限公司,从事机械、新能源、汽车行业研究工作。

注:任职日期根据基金管理人对外披露的任职日期填写;证券从业年限以从事证券业务相关的工作时间为计算标准。

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,并涵盖投权、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

刚刚过去的2015年是资本市场跌宕起伏的一年,是不断颠覆传统和经验的一年,也是值得我们深刻总结和反思的一年。2015年前5个月,市场在改革和转型的美好憧憬下,走出了波澜壮阔的行情。但是,从4月份开始,管理层通过加快新股发行节奏、扩大融券、限制伞形信托等手段调节市场资金面,表明资金和政策面均出现变化。随后,市场从6月份开始出现大幅下跌,直到9月份市场逐步企稳并启动了一波大幅反弹。

基金通乾在2015年上半年坚持了均衡配置的思路,既配置了稳定成长的行业,又挖掘了新兴行业的股票。我们认为6月份市场的下跌,根源是市场自身出现了高估,因此,我们对整个下半年的思路都较为谨慎。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为18.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾历史,我们发现,在转型的憧憬下,创业板综指已经连续上涨3年,整体估值水平也从二十多倍上涨至六十多倍。从实体经济来看,在去产能的大背景下,2016年经济下行压力仍然很大,银行呆坏帐有上升风险,接下来银行的应对措施很有可能是收缩资产负债报表。从无风险利率来看,10年期国债已经从2014年初的4.6%下降至2015年底的2.8%,进一步下降的空间不大。因此,我们认为,以创业板为代表的新兴产业整体估值继续扩张的难度较大,而传统经济的去产能去库存又是漫长的而痛苦的过程,所以,对于未来一段时间,我们对于市场的看法较为谨慎。

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19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2.00元。

(2)截止本报告期末,本基金每基金份额期末可供分配利润0.6149元,本基金管理人拟在2016年4月19日发布本基金2015年年度收益分配公告。本基金利润分配情况,符合基金合同的约定。

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

无。

§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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金实施利润分配的金额为400,000,000.00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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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21156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:通乾证券投资基金

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	24,850,054.99	123,559,456.74
结算备付金	7,085,742.47	14,409,478.19
存出保证金	1,915,772.30	930,267.82
交易性金融资产	3,276,353,813.55	3,118,782,232.72
其中:股票投资	2,293,004,813.55	2,459,923,232.72
基金投资	-	-
债券投资	983,349,000.00	658,859,000.00
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	42,319,235.56	-
应收利息	23,399,535.54	20,424,510.92
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,375,924,154.41	3,278,105,946.39
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	5,386,800.54	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	4,255,793.38	3,853,816.13
应付托管费	709,298.88	642,302.70
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,507,655.84	3,397,262.84
应交税费	1,830,675.94	1,830,675.94
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,098,000.00	1,098,000.00
负债合计	17,788,224.58	10,822,057.61
所有者权益:		
实收基金	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未分配利润	1,358,135,929.83	1,267,283,888.78
所有者权益合计	3,358,135,929.83	3,267,283,888.78
负债和所有者权益总计	3,375,924,154.41	3,278,105,946.39

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.6791元,基金份额总额2,000,000,000.00份。

7.2 利润表

会计主体:通乾证券投资基金

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	584,440,608.15	1,110,256,092.45
1.利息收入	33,967,039.32	23,060,093.94
其中:存款利息收入	1,565,877.83	1,332,275.28
债券利息收入	32,275,241.75	21,371,331.57
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	125,919.74	356,487.09
其他利息收入	-	-
2.投资收益	1,266,548,814.89	451,350,652.72
其中:股票投资收益	1,246,795,733.80	442,410,867.22
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6,517,385.22	-1,777,205.75
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	13,235,695.87	10,716,991.25
3.公允价值变动收益	-716,075,246.06	635,844,937.67
4.汇兑收益	-	-
5.其他收入	-	408.12
减:二、费用	93,588,567.10	56,260,510.00
1.管理人报酬	49,604,501.49	34,492,112.15
2.托管费	8,267,416.90	5,748,996.63
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	33,900,173.06	15,310,606.86
5.利息支出	-	75,136.83
其中:卖出回购金融资产支出	-	75,136.83
6.其他费用	1,816,475.65	633,657.53
三、利润总额	490,852,041.05	1,053,995,582.45
减:所得税费用	-	-
四、净利润	490,852,041.05	1,053,995,582.45

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:通乾证券投资基金

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)	2,000,000,000.00	1,267,283,888.78	3,267,283,888.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	490,852,041.05	490,852,041.05
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-400,000,000.00	-400,000,000.00
五、期末所有者权益(基金净值)	2,000,000,000.00	1,358,135,929.83	3,358,135,929.83
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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)	2,000,000,000.00	263,288,309.77	2,263,288,309.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,053,995,582.45	1,053,995,582.45
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-50,000,003.44	-50,000,003.44
五、期末所有者权益(基金净值)	2,000,000,000.00	1,267,283,888.78	3,267,283,888.78

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:

_____孟朝霞_____ _____颜锡服_____ _____刘关丽_____

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

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	基金管理人、基金发起人
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人
新时代证券股份有限公司("新时代证券")	基金管理人股东
日兴资产管理有限公司	基金管理人股东
北京奇睿天使投资咨询有限公司("奇睿天使")	基金发起人
陕西省国际信托股份有限公司("陕国投")	基金发起人
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。

根据《通乾证券投资基金基金合同》的规定,基金发起人发起设立基金时认购的基金份额,可在基金上市一年后,按各发起人持有份额50%的比例上市流通。原基金发起人之一的河北证券自于2007年7月24日被石家庄市中级人民法院受理进入破产清算程序,根据破产管理人的申请,自2011年9月8日起河北证券所持有的发起人份额中250万份基金份额可上市流通。剩余250万份基金份额已于2010年12月31日通过公开拍卖方式转让给北京奇睿天使投资咨询有限公司并由其承接河北证券作为发起人的权利义务,基金过户相关手续已于2011年1月26日完成。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元发生交易。

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

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股票交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的交易佣金。

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	49,604,501.49	34,492,112.15
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

注:支付基金管理人融通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%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×1.5% / 当年天数。

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	8,267,416.90	5,748,996.63

注:支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数。

7.4.3.2.3 销售服务费

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生销售服务费。

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

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(2001年8月29日)持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期末持有的基金份额占基金份额比例	0.5000%	0.5000%

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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2015年12月31日		上年度末 2014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
陕国投	2,500,000.00	0.1250%	2,500,000.00	0.1250%
奇睿天使	2,500,000.00	0.1250%	2,500,000.00	0.1250%

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	24,850,054.99	1,401,048.71	123,559,456.74	1,242,613.57

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行约定利率计息。

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金本报告期及上年度可比期间均未买入管理人、托管人的控股股东在承销期内担任副主承销商或分销商所承销的证券;

2、本基金本报告期及上年度可比期间均未买入管理人、托管人的主要股东(非控股)在承销期内承销的证券。

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(2015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

本基金本报告期末及上年度末未持有因认购新发或增发而流通受限证券。

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
000028	国药一致	2015年10月21日	重大资产重组	69.67	2016年3月25日	63.05	2,186,639	151,026,522.72	152,343,139.13	-
600990	四创电子	2015年8月31日	重大资产重组	82.63	2016年3月25日	69.03	1,000,000	60,977,879.14	82,630,000.00	-
002246	北化股份	2015年11月23日	重大资产重组	14.12	-	-	492,934	5,706,231.17	6,960,228.08	-

注:本基金截至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(%)
1	权益投资	2,293,004,813.55	67.92
	其中:股票	2,293,004,813.55	67.92
2	固定收益投资	983,349,000.00	29.13
	其中:债券	983,349,000.00	29.13
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	31,935,797.46	0.95
7	其他各项资产	67,634,543.40	2.00
8	合计	3,375,924,154.41	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	405,902,058.37	12.09
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,085,082,391.84	32.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	230,121,209.74	6.85
G	交通运输、仓储和邮政业	70,422,067.69	2.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	129,196,857.00	3.85
J	金融业	-	-
K	房地产业	146,949,695.02	4.38
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	176,484,454.79	5.26
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	48,846,079.10	1.45
S	综合	-	-
	合计	2,293,004,813.55	68.28

1.1 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	002299	圣农发展	7,299,528	160,516,620.72	4.78
2	000028	国药一致	2,186,639	152,343,139.13	4.54
3	600305	恒顺醋业	5,088,705	130,627,057.35	3.89
4	002126	银轮股份	6,599,741	121,765,221.45	3.63
5	300145	南方泵业	2,307,898	109,902,102.76	3.27
6	600587	新华医疗	2,849,909	103,537,193.97	3.08
7	600756	浪潮软件	1,899,900	97,711,857.00	2.91
8	002234	民和股份	5,099,821	91,694,781.58	2.73
9	002746	仙坛股份	2,335,035	87,797,316.00	2.61
10	600990	四创电子	1,000,000	82,630,000.00	2.46

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。

1.2 报告期内股票投资组合的重大变动

1.2.1 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	294,912,702.50	9.03
2	000028	国药一致	284,954,574.53	8.72
3	600270	外运发展	248,103,010.21	7.59
4	600305	恒顺醋业	205,843,313.59	6.30
5	601688	华泰证券	186,154,227.98	5.70
6	601169	北京银行	182,621,125.40	5.59
7	000024	招商地产	179,437,044.45	5.49
8	300273	和佳股份	177,166,090.65	5.42
9	002260	德奥通航	173,047,235.28	5.30
10	300016	北陆药业	162,934,502.54	4.99
11	002308	威创股份	159,924,936.00	4.89
12	002466	天齐锂业	159,718,900.91	4.89
13	601998	中信银行	157,771,195.83	4.83
14	600048	保利地产	153,327,019.72	4.69
15	002299	圣农发展	153,246,473.47	4.69
16	000423	东阿阿胶	150,816,906.07	4.62
17	002488	金固股份	147,861,775.38	4.53
18	002022	科华生物	147,452,436.61	4.51
19	002049	同方国芯	146,189,539.78	4.47
20	600358	国旅联合	145,584,369.13	4.46
21	002318	久立特材	145,136,924.65	4.44
22	002126	银轮股份	128,902,829.82	3.95
23	000687	华讯方舟	124,096,569.14	3.80
24	000998	隆平高科	122,236,895.34	3.74
25	000895	双汇发展	121,999,280.24	3.73
26	002055	得润电子	121,905,378.46	3.73
27	300159	新研股份	121,742,998.24	3.73
28	600756	浪潮软件	120,285,355.22	3.68
29	600486	扬农化工	118,182,036.05	3.62
30	600622	嘉宝集团	116,252,952.65	3.56
31	000732	泰禾集团	116,201,153.63	3.56
32	600570	恒生电子	114,062,117.02	3.49
33	002594	比亚迪	110,581,162.58	3.38
34	000581	威孚高科	109,345,942.81	3.35
35	300147	香雪制药	104,890,084.37	3.21
36	600480	凌云股份	104,577,308.65	3.20
37	002292