融通通泽灵活配置混合型证券投资基金

【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:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2016年3月30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本基金基金合同规定,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。

融通通泽灵活配置混合型证券投资基金由融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金转型而成。根据融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议,融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金展期并转型为融通通泽灵活配置混合型证券投资基金,转型后本基金的投资目标、投资范围和策略均与转型前基金相同。

自2014年9月2日起,转型后的《融通通泽灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效。

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	融通通泽灵活配置混合
基金主代码	000278
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年8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	2,408,551,535.95份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求本金安全的基础上,通过大类资产配置与个券选择,采用数量化手段严格控制本基金的下行风险,力争在越小波动性的同时(在有效时间内为投资者创造8%的累计目标收益,为基金份额持有人追求资产的稳定增值。
投资策略	本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略,将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、行业细分、公司价值评估以及组合风险管理全过程中。
业绩比较基准	年化收益率8%。
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与货币市场基金,低于股票型基金,属于中高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	徐卫东	洪渊
	联系电话	(0755)26948966	(010)66106799
	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)66106798
注册地址		深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		518053	100140
法定代表人		高峰	姜建清

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、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8月30日(基金合同生效日)-2013年12月31日
本期已实现收益	228,756,993.39	55,424,419.06	-46,852,461.74
本期利润	265,643,568.19	52,051,184.14	-32,942,977.54
加权平均基金份额本期利润	0.0690	0.0630	-0.0379
本期基金份额净值增长率	-0.60%	11.99%	0.00%
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	-0.0078	-0.0060	-0.0539
期末基金资产净值	2,389,771,063.49	235,129,696.52	836,361,111.44
期末基金份额净值	0.992	0.998	0.962

注:(1)本基金由《融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金》转型而来,融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金合同生效日为2013年8月30日,自2014年9月2日起,转型后的《融通通泽灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效。因本基金转型前后投资目标、投资范围策略及业绩比较基准均与转型前相同,上述指标计算不再分转型前后。

(2)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。

(3)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。

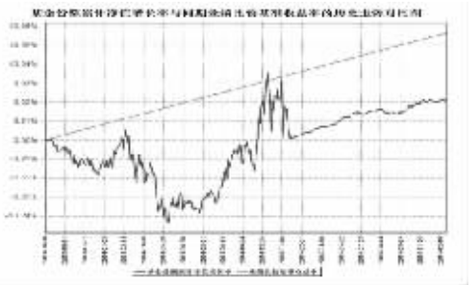
(4)期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配利润:如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

3.2 基金净值表现

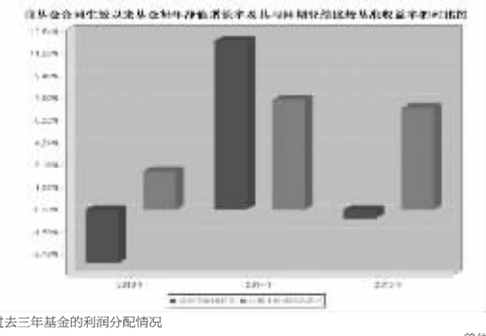
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	2.06%	0.13%	2.02%	0.00%	0.04%	0.13%
过去六个月	2.16%	0.13%	4.03%	0.00%	-1.87%	0.13%
过去一年	-0.60%	0.62%	8.00%	0.00%	-8.60%	0.62%
自基金合同生效起至今	7.09%	0.80%	18.74%	0.00%	-11.65%	0.80%

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 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



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	-	-	-	-	?
2014	0.8000	19,007,221.28	246,678.68	19,253,899.96	?
2013	-	-	-	-	?
合计	0.8000	19,007,221.28	246,678.68	19,253,899.96	?

§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。

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		
俞志勇	本基金、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的基金经理	2015年2月26日	-	14	金融学硕士,具有基金从业资格。先后任职于湖北省农业厅、南发证券、2004年加入招商证券股份有限公司研究发展中心,从事房地产行业研究工作。2007年加入融通基金管理有限公司,曾任研究部行业研究员、行业组长。
丁晓伟	本基金的基金经理、融通动力先锋混合、融通转型三动力混合的基金经理	2014年7月23日	2015年3月28日	6	工学硕士,具有基金从业资格。2003年3月至2008年6月在浙江国华浙能发电有限公司工作,任技术主管;2008年7月至2009年7月在元大证券(香港)有限公司上海代表处工作,任行业分析师;2009年4月至2011年5月在新华基金管理有限公司工作,任行业分析师。2011年5月加入融通基金管理公司,历任投资经理助理、投资经理。

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

本基金1月份由于持有金融股仓位较重,净值出现了一定幅度的下跌;从2月份开始,本基金转为绝对收益策略,主要是保持基金净值增长率的平稳性,操作策略一直保持低仓位,用更多的资金积极参与新股的发行,同时将富余的资金适当的配置在高流动性债券和回购类资产,获得较好的稳定收益,并成功回避了三季度股市的大跌。

三季度IPO被暂停,本基金原有的操作策略受到了一定的冲击。本基金在三季度大盘底部适度增持了一部分股票,随着市场估值修复,本基金则逐步降低了股票仓位,整体风险控制得较好。在11月份IPO重启后,本基金又重新调整到以新股申购为主的策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金净值份额净值增长率为-0.60%,业绩比较基准增长率为8.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年资本市场会出现大波动、大分化的格局,一方面中国经济依然面临着较大的下行压力,国际环境也存在很多的变数;另一方面中国政府正在全力推行各项改革和和经济转型,资本市场将会不可避免地受到各种因素的冲击呈现大的波动。

本基金2016年将重点关注两大类机会:一方面坚定看好新经济的投资机会,例如传媒、云计算等板块,随着中国社会的发展,新消费、新技术领域一定会逐步成为支持社会发展的新动力。另一方面,我们也密切关注传统产业的转型和升级,供给侧改革和新基建将为传统经济带来新的投资机会。

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

本基金本报告期内未进行利润分配,符合法律法规和基金合同的规定。

§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泽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,融通通泽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通泽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,融通通泽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通泽灵活配置混合型证券投资基金2015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21178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:融通通泽灵活配置混合型证券投资基金
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	326,579,431.72	50,750,487.82
结算备付金	393,607.57	4,677,901.70
存出保证金	257,112.62	1,107,059.10
交易性金融资产	1,457,609,726.10	182,573,714.38
其中:股票投资	91,403,126.10	182,573,714.38
基金投资	-	-
债券投资	1,366,206,600.00	-
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	593,701,610.16	-
应收证券清算款	2,685,671.13	-
应收利息	13,537,664.92	13,562.46
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,393,754,824.51	239,122,725.46
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	-	-
应付赎回款	98,022.72	1,253,471.96
应付管理人报酬	3,039,190.11	414,428.98
应付托管费	506,531.66	69,071.53
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	264,015.53	2,180,056.47
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	76,000.00	76,000.00
负债合计	3,983,761.02	3,993,028.94
所有者权益:		
实收基金	2,408,551,535.95	235,493,342.00
未分配利润	-18,780,472.46	-363,645.48
所有者权益合计	2,389,771,063.49	235,129,696.52
负债和所有者权益总计	2,393,754,824.51	239,122,725.46

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值0.992元,基金份额总额2,408,551,535.95份。

7.2 利润表

会计主体:融通通泽灵活配置混合型证券投资基金
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	344,324,861.50	74,562,874.85
1.利息收入	92,545,998.04	7,104,017.86
其中:存款利息收入	29,180,835.79	3,668,856.01
债券利息收入	42,061,776.10	2,165,234.50
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	21,303,374.15	1,269,927.35
其他利息收入	-	-
2.投资收益	193,909,969.57	70,822,067.90
其中:股票投资收益	189,087,353.65	69,272,549.70
基金投资收益	-	-
债券投资收益	4,532,481.95	-876,850.67
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	290,116.97	2,426,348.87
3.公允价值变动收益	36,887,674.80	-3,373,234.92
4.汇兑收益	-	-
5.其他收入	20,981,341.09	2401
减:二、费用	78,681,293.31	22,501,690.71
1、管理人报酬	64,137,301.95	2,696,312.71
2、托管费	10,689,550.35	1,792,211.62
3、销售服务费	-	-
4、交易费用	2,039,331.95	17,622,892.13
5、利息支出	1,443,579.77	2,661.65
其中:卖出回购金融资产支出	1,443,579.77	2,661.65
6、其他费用	372,529.29	387,612.60
三、利润总额	265,643,568.19	52,061,184.14
减:所得税费用	-	-
四、净利润	265,643,568.19	52,051,184.14

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:融通通泽灵活配置混合型证券投资基金
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)	235,493,342.00	-363,645.48	235,129,696.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	265,643,568.19	265,643,568.19
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	2,173,058,193.95	-284,060,395.17	1,888,997,798.78
其中:1.基金申购款	10,568,961,573.02	-532,626,773.09	10,036,434,799.93
2.基金赎回款	-8,395,903,379.07	248,566,377.92	-8,147,437,001.15
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)	2,408,551,535.95	-18,780,472.46	2,389,771,063.49
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)	869,304,088.98	-32,942,977.54	836,361,111.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	52,051,184.14	52,051,184.14
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-633,810,746.98	-217,952.12	-634,028,699.10
其中:1.基金申购款	252,744.52	-6,065.84	246,678.68
2.基金赎回款	-634,063,491.50	-211,886.28	-634,275,377.78
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-19,253,899.96	-19,253,899.96
五、期末所有者权益(基金净值)	235,493,342.00	-363,645.48	235,129,696.52

注:报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

_____孟朋霞_____ _____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

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。

7.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
融通基金管理有限公司	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	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”)	基金管理人的股东、基金代销机构
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。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

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	232,433,776.72	19.67%	2,676,610,515.35	23.13%

7.4.4.1.2 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。

7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 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	212,179.85	19.79%	20,195.62	9.91%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
新时代证券	2,436,787.22	23.53%	531,098.64	24.39%

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。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 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	64,137,301.95	2,696,312.71
其中:支付销售机构的客户维护费	726,476.62	1,296,112.32

注:1.本基金在转型前未收取管理费。本基金在转型后,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。

2.客户维护费是基金管理人与基金销售机构约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的费用,用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支,不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 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	10,689,550.35	1,792,211.62

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:

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本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。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金,管理人均未运用固有资金投资本基金。

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末,基金管理人主要股东及其控制的机构均未持有本基金份额。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 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
中国工商银行	26,579,431.72	5,570,412.74	50,750,487.82	1,253,817.32

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金本报告期和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、本基金本报告期和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)在承销期承销的证券。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项的说明。

7.4.5 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别:股票									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300463	迈克生物	2015年6月21日	2016年6月28日	限售股	27.96	117.39	233,333	6,523,990.68	27,390,960.87	-
300443	金雷风电	2015年4月16日	2016年4月22日	限售股	31.94	193.32	65,566	2,094,178.04	12,675,219.12	-
300436	广生堂	2015年4月16日	2016年4月22日	限售股	21.47	83.43	47,297	1,015,466.59	3,945,988.71	-
300436	广生堂	2015年8月16日	2016年4月22日	限售股转增股	-	83.43	47,297	-	3,945,988.71	-
002278	高科石化	2015年12月28日	2016年1月6日	新股流通受限	8.50	8.50	5,600	47,600.00	47,600.00	-

注:(1)基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

(2)本基金于2015年4月16日认购广生堂公开发行股票并自愿锁定12个月,认购数量47,297股;2015年9月16日,广生堂实施每10股转增10股的权益分配方案,上表中的数量为送股实施后的总股数;

(3)除上述股票外,本基金于本报告期末无其他因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因从事银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因从事交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	91,403,126.10	3.82
	其中:股票	91,403,126.10	3.82
2	固定收益投资	1,366,206,600.00	57.07
	其中:债券	1,366,206,600.00	57.07
	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	593,701,610.16	24.80
	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	326,963,039.29	13.62
7	其他各项资产	16,480,448.57	0.69
8	合计	2,393,754,824.51	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	70,107,360.67	2.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	195,136.20	0.01
F	批发和零售业	222,304.44	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,336,206.18	0.31
J	金融业	12,450,000.00	0.52
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	109,392.21	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	982,724.60	0.04
S	综合	-	-
	合计	91,403,126.10	3.82

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	300463	迈克生物	233,333	27,390,960.87	1.15
2	300443	金雷风电	65,566	12,675,219.12	0.53
3	600837	海通证券	600,000	9,492,000.00	0.40
4	002167	正邦科技	400,000	8,040,000.00	0.34
5	300436	广生堂	94,594	7,891,977.42	0.33
6	002217	合力泰	300,000	5,085,000.00	0.21
7	300271	华宇软件	100,000	4,748,000.00	0.20
8	600439	瑞贝卡	500,000	3,550,000.00	0.15
9	002127	新民科技	162,700	3,045,744.00	0.13
10	601688	华泰证券	150,000	2,958,000.00	0.12

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于基金管理人融通基金管理有限公司网站(http://www.rtfund.com)的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	55,806,243.79	23.73
2	601985	中国核电	32,649,100.17	13.89
3	300186	大华农	26,663,674.52	11.34
4	600885	宏发股份	23,148,138.00	9.84
5	002157	正邦科技	20,799,841.00	8.85
6	002007	华兰生物	20,569,067.44	8.74
7	600587	新华医疗	20,489,300.28	8.71
8	002271	东方雨虹	15,182,779.14	6.46
9	300352	北信源	13,961,679.89	5.94
10	300198	纳川股份	12,144,018.10	5.16
11	000422	湖北宜化	11,662,893.28	4.96
12	300498	温氏股份	11,430,000.00	4.86
13	002481	双塔食品	10,781,541.77	4.