融通巨潮100指数证券投资基金(LOF) 2016年年度报告摘要

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:2017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融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)(以下简称"本基金")基金合同规定,于2017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)为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2016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	融通巨潮100指数(LOF)
场内简称	融通巨潮
基金主代码	161607
前端交易代码	161607
后端交易代码	161657
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2006年5月12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	780,158,852.72份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2006年6月16日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型指数基金。在控制股票投资组合相对巨潮100目标指数跟踪误差的基础上,力求获得超越巨潮100目标指数的投资收益,追求长期的资本增值。本基金谋求分享中国经济的持续、稳定增长和中国证券市场发展的成果,实现基金资产的长期增长,为投资者带来稳定的回报。
投资策略	基金以指数化分散投资为主要投资策略,在此基础上进行适度的主动调整,在数量化投资技术与基本面深入研究的结合中谋求基金投资组合在偏离风险及超额收益间的最佳匹配。为控制基金偏离目标指数的风险,本基金力求将基金份额净值增长率与目标指数增长率间的日跟踪误差控制在0.5%。
业绩比较基准	巨潮100指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。
风险收益特征	风险和预期收益率授定市场平均水平。

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	郭明
	联系电话	(0755)26948966	(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	www.rtfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处、深圳证券交易所

§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

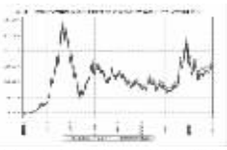
3.1.1 期间数据和指标	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	-15,129,624.64	630,039,565.32	-30,866,040.69
本期利润	-54,739,542.43	164,491,144.65	810,661,706.91
加权平均基金份额本期利润	-0.0674	0.1212	0.3667
本期基金份额净值增长率	-5.97%	-3.20%	56.76%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0421	-0.0298	-0.4354
期末基金资产净值	798,044,831.60	897,536,897.17	2,317,847,796.28
期末基金份额净值	1.023	1.069	1.124

3.2 基金净值表现

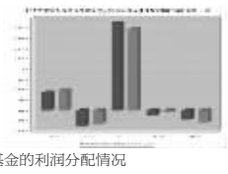
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	4.07%	0.80%	2.86%	0.69%	1.21%	0.11%
过去六个月	8.03%	0.81%	5.35%	0.71%	2.68%	0.10%
过去一年	-5.97%	1.33%	-7.75%	1.23%	1.78%	0.10%
过去三年	42.68%	1.77%	39.36%	1.68%	3.32%	0.09%
过去五年	42.88%	1.60%	44.27%	1.53%	-1.39%	0.07%
自基金合同生效起至今	240.75%	1.84%	262.08%	1.74%	-21.33%	0.10%

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

无。

§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2016年12月31日,公司共管理六十二只开放式基金: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、融通通景混合基金、融通国企改革新机遇混合基金、融通通尚混合基金、融通新优选混合基金、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、融通通玺债券基金和融通通穗债券基金。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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李勇	本基金的基金经理	2015年1月9日	-	11	李勇先生,厦门大学经济学硕士,安徽大学数学学士,11年证券投资从业经历,具有基金从业资格。2005年1月入职融通基金管理有限公司,历任金融工程研究员、基金经理助理职务。现任融通深证成份指数、融通创业板指数、融通巨潮100指数(LOF)基金的基金经理。
蔡志伟	本基金的基金经理	2015年2月11日	-	5	蔡志伟先生,华南师范大学计算机硕士,广州大学计算机学士,金融风险管理师(FRM),5年证券投资从业经历,具有基金从业资格。曾就职于汇丰软件开发广东有限公司任高级软件工程师(SSE),2011年6月加入融通基金管理有限公司,历任风险管理专员、金融工程研究员,现任融通巨潮100指数(LOF)、融通深证成份指数、融通创业板指数基金的基金经理。

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

在严格遵守基金合同的前提下实现持有人利益的最大化是本基金管理的核心思想,并将此原则贯彻于基金的运作之中。本基金运用指数化投资方式,采取量化策略进行指数增强和风险管理,在控制基金相对巨潮100指数基金基准的跟踪误差下,力求最终为投资者带来超越基金基准的收益。

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-5.97%,基金业绩比较基准收益率为-7.75%。

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2017年,全球经济偏弱,中国宏观经济基本面总体偏稳,经济边际改善与结构隐忧并存,积极财政政策仍将是明年总基调,PPP项目将持续发力。在16年政策持续发力供给端下,已经引起原材料价格的波动,明年石油价格有望上行,人民币汇率下跌也带来输入性通胀,明年温和通胀的可能性加大,而从历史经验上看,温和通胀阶段企业盈利向好,但企业基本面根本性的好转仍需时日。未来经济增速保持平稳较高水平需要依靠推进改革转型,比如高新技术产业、消费、服务业,正在经济缓慢触底过程中不断得到加强。而传统增长引擎像房地产、汽车行业也有望在行业制度建设完善、供给结构改善后迎来持续健康的增长。在此经济环境下,本基金将积极寻找行业景气度上行,企业基本面向好的优质蓝筹股。

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巨潮100指数证券投资基金(LOF)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,融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)的管理人——融通基金管理有限公司在融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)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,融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)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巨潮100指数证券投资基金(LOF)2016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2016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(2017)第21213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:融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)

报告截止日:2016年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资 产:		
银行存款	9,711,895.59	45,896,950.75
结算备付金	2,475,502.70	1,398,521.53
存出保证金	132,948.40	230,945.69
交易性金融资产	787,350,273.08	853,708,582.34
其中:股票投资	757,350,273.08	853,708,582.34
基金投资	-	-
债券投资	30,000,000.00	-
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	3,902,086.62	-
应收利息	734,101.62	10,021.05
应收股利	-	-
应收申购款	51,887.68	71,843.08
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	804,358,695.69	901,306,864.44
负债和所有者权益	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015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	3,226,594.64	-
应付赎回款	290,268.16	1,748,369.60
应付管理人报酬	907,111.36	996,110.62
应付托管费	139,565.61	153,247.77
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,405,120.30	523,843.21
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	345,214.02	348,396.07
负债合计	6,313,864.09	3,769,967.27
所有者权益:		
实收基金	780,158,852.72	825,119,992.48
未分配利润	17,885,978.88	72,416,904.69
所有者权益合计	798,044,831.60	897,536,897.17
负债和所有者权益总计	804,358,695.69	901,306,864.44

注:报告截止日2016年12月31日,基金份额净值1.023元,基金份额总额780,158,852.72份。

7.2 利润表

会计主体:融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)

本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
一、收入	-34,854,182.24	197,250,856.23
1.利息收入	771,587.33	1,443,994.63
其中:存款利息收入	150,038.15	528,068.60
债券利息收入	621,549.18	915,926.03
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	3,920,198.10	659,944,357.29
其中:股票投资收益	-12,152,905.97	635,817,082.15
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-2,960.00
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	16,073,104.07	24,130,235.14
3.公允价值变动收益	-39,609,917.79	-465,548,420.67
4.汇兑收益	-	-
5.其他收入	63,950.12	1,410,924.98
减:二、费用	19,885,360.19	32,759,711.58
1. 管理人报酬	10,259,483.08	20,766,363.00
2. 托管费	1,578,382.05	3,194,825.08
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	7,573,871.06	8,223,906.21
5. 利息支出	-	946.92
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	473,624.00	573,670.37
三、利润总额	-54,739,542.43	164,491,144.65
减:所得税费用	-	-
四、净利润	-54,739,542.43	164,491,144.65

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)

本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 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)	825,119,992.48	72,416,904.69	897,536,897.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-54,739,542.43	-54,739,542.43
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-44,961,139.76	208,616.62	-44,752,523.14
其中:1.基金申购款	76,656,427.84	-3,004,590.77	73,651,837.07
2.基金赎回款	-121,617,567.60	3,213,207.39	-118,404,360.21
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)	780,158,852.72	17,885,978.88	798,044,831.60
项目	上年度可比期间 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)	2,061,299,663.26	256,548,133.02	2,317,847,796.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	164,491,144.65	164,491,144.65
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,236,179,670.78	-348,622,372.98	-1,584,802,043.76
其中:1.基金申购款	708,872,839.60	112,219,844.19	821,092,683.79
2.基金赎回款	-1,945,052,510.38	-460,842,217.17	-2,405,894,727.55
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)	825,119,992.48	72,416,904.69	897,536,897.17

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:

_____高峰_____ _____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。

7.4.2 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、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")	基金管理人股东、基金销售机构
日兴资产管理有限公司	基金管理人股东
深圳市融通资本管理股份有限公司(原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

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	2,700,210,970.17	54.13%	3,766,903,692.77	76.62%

7.4.4.1.2 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。

7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 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	2,514,704.49	54.54%	412,739.19	29.37%
	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	3,440,943.68	77.02%	406,118.02	77.53%

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。

7.4.4.2 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 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	10,259,483.08	20,766,363.00
其中:支付销售机构的客户维护费	2,006,167.57	3,382,859.12

注:1、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1.30%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×1.30% / 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 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,578,382.05	3,194,825.08

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。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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。

7.4.4.4 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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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
中国工商银行股份有限公司	9,711,895.59	116,792.12	45,896,950.75	473,124.34

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。

7.4.4.7 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。

7.4.5 期末(2016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

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
601375	中原证券	2016-12-20	2017-1-3	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603228	景旺电子	2016-12-28	2017-1-6	新股流通受限	23.16	23.16	3,491	80,851.56	80,851.56	-
603877	太平鸟	2016-12-29	2017-1-9	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300683	赛托生物	2016-12-29	2017-1-6	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603689	皖天然气	2016-12-30	2017-1-10	新股流通受限	7.87	7.87	4,819	37,925.53	37,925.53	-
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-1-5	新股流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龙股份	2016-12-30	2017-1-10	新股流通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
300687	天铁股份	2016-12-28	2017-1-5	新股流通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	2016-12-29	2017-1-10	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016-12-28	2017-1-6	新股流通受限	15.28	15.28	682	10,420.96	10,420.96	-
603186	华正新材	2016-12-26	2017-1-3	新股流通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016-12-27	2017-1-5	新股流通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300696	美联新材	2016-12-26	2017-1-4	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016-12-30	2017-1-10	新股流通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	2016-12-27	2017-1-5	新股流通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

注: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。

7.4.5.2 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
600400	红豆股份	2016-12-29	重大资产重组	8.56	-	-	147,600	1,270,920.00	1,263,456.00	-
601727	上海电气	2016-8-31	重大事项	8.42	-	-	41,400	452,748.10	348,588.00	-
000166	申万宏源	2016-12-21	重大事项	6.25	2017-1-26	6.29	2,203	13,848.98	13,768.75	-
300104	乐视网	2016-12-7	重大资产重组	35.80	2017-1-16	36.88	100	5,225.22	3,580.00	-

注:本基金截至2016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。

7.4.5.3 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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	757,350,273.08	94.16
	其中:股票	757,350,273.08	94.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	30,000,000.00	3.73
	其中:债券	30,000,000.00	3.73
	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	12,187,398.29	1.52
8	其他各项资产	4,821,024.32	0.60
9	合计	804,358,695.69	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	281.76	0.00
B	采矿业	24,167,153.88	3.03
C	制造业	170,839,784.62	21.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,225.73	0.00
E	建筑业	39,873,524.68	5.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	33,897.68	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,965,014.67	3.00
J	金融业	395,441,997.04	49.55
K	房地产业	23,815,347.69	2.98
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	-	-
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	429.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	678,162,656.75	84.98

8.2.2 期末积极投资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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	50,788,947.29	6.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,444,376.53	0.31
E	建筑业	15,592.23	0.00
F	批发和零售业	2,386,800.00	0.30
G	交通运输、仓储和邮政业	2,403,428.68	0.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	241,692.20	0.03
J	金融业	6,181,794.40	0.77
K	房地产业	7,078,499.00	0.89
L	租赁和商务服务业	3,863,583.00	0.48
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	3,782,904.00	0.47
S	综合	-	-
	合计	79,187,616.33	9.92

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

8.3.1 期末指数投资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(%)