融通通利系列证券投资基金之融通深证100指数证券投资基金 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

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深证100指数证券投资基金(以下简称"本基金")2016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	融通深证100指数
基金主代码	161604
前端交易代码	161604
后端交易代码	161654
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	4,265,907,259.80份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	运用指数化投资方式,通过控制股票投资组合与深证100指数的跟踪误差,力求实现对深证100指数的有效跟踪,谋求分享中国经济的持续、稳定增长和中国证券市场的发展,实现基金资产的长期增长,为投资者带来稳定回报。
投资策略	以非债券资产90%以上的资金对深证100指数的成份股进行股票指数化投资。股票指数化投资部分不得低于基金资产的80%,采用复制法跟踪深证100指数,对于因流动性等原因导致无法完全复制深证100指数的情况,将采用剩余组合替换等方法避免跟踪误差扩大。
业绩比较基准	深证100指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%
风险收益特征	风险和预期收益率接近市场平均水平。

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)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	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	-8,535,336.19	3,822,841,823.29	-341,938,082.75
本期利润	-996,833,089.05	3,211,294,183.83	3,343,755,370.86
加权平均基金份额本期利润	-0.2279	0.5069	0.2630
本期基金份额净值增长率	-15.07%	20.79%	32.60%
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	0.2381	0.4164	-0.1665
期末基金资产净值	5,281,790,736.30	6,576,144,170.26	12,476,977,601.52
期末基金份额净值	1.238	1.464	1.212

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)。

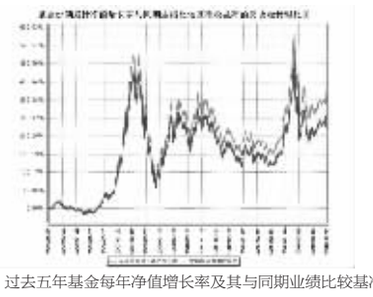
3.2 基金净值表现

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

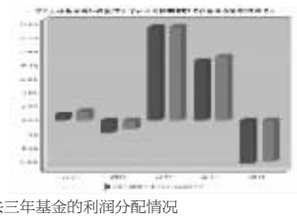
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.05%	0.83%	-2.92%	0.83%	-0.13%	0.00%
过去六个月	1.14%	0.92%	-0.13%	0.90%	1.27%	0.02%
过去一年	-15.07%	1.77%	-14.24%	1.57%	-0.83%	0.20%
过去三年	36.03%	1.98%	39.42%	1.81%	-3.39%	0.17%
过去五年	33.12%	1.76%	39.54%	1.64%	-6.42%	0.12%
自基金合同生效起至今	267.31%	1.80%	336.65%	1.75%	-69.34%	0.05%

注:本基金业绩比较基准项目分段计算,其中:2005年8月21日之前(含此日)采用"深证100指数×75%+银行间债券综合指数×25%",2005年8月22日起使用新基准即"深证100指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%"。

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
2016	0.050	6,156,236.44	16,460,512.64	22,616,749.08	-
2015	-	-	-	-	-
2014	-	-	-	-	-
合计	0.050	6,156,236.44	16,460,512.64	22,616,749.08	-

§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(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		
何天翔	本基金的基金经理。	2014/10/25	-	8	何天翔先生,厦门大学经济学硕士、安徽大学理学学士,8年证券投资从业经历,具有基金从业资格。曾就职于华泰联合证券有限公司任金融工程分析师。2010年3月加入融通基金管理有限公司,历任金融工程研究员、专户投资投资经理。现任融通深证100指数、融通军工分级、融通证券分级、融通中证大农业指数基金(LOF)(由原融通农业分级转型而来)、融通新趋势灵活配置混合、融通国企改革新机遇灵活配置混合、融通通瑞债券基金的基金经理。

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

2016年我国宏观经济整体呈L型的新常态运行,经济增速和通胀水平保持在合理健康的发展区间。四季度来看,受益于供给侧改革的坚定推进和实体主动补库周期,PPI于12月快速回升至+5%,PMI也连续3个月站稳51以上,同时CPI由低位反弹至2.1%,同时中微观看,重卡、工程机械等中游行业在补库存周期的带动下,销量同比增速好于预期,上市公司3季度的业绩增速也出现持续改善。

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始终。本基金运用指数化投资策略,通过控制股票投资权重与深证100指数成份股自然权重的偏离,有效控制跟踪误差,为投资者提供投资深证100指数的一个有效工具。

本报告期内,本基金日均跟踪偏离为0.14%,年化跟踪误差为3.80%,符合基金合同约定。

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-15.07%,基金业绩比较基准收益率为-14.24%。

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,一季度由于基建投资需求的加码、供给侧改革的推进,预期PPI和CPI仍将持续高位,同时2016年12月的新增信贷高达1.04万亿元,超出市场预期,并预计2017年1月份仍将大量信贷投放,主要由于银行储备项目丰富、制造业信贷需求回暖,叠加按揭贷款的滞后效应,因此预计17年一季度各项经济指标将持续企稳。全年来看,严控泡沫的地产投资将会下滑,期待改革的持续推进,带来改革红利和结构改善。

证券市场方面,大盘经过10月-11月两个月的持续反弹后,12月初至今出现了一定调整,主要压制因素包括债市去杠杆、IPO资金分流效应、汇率大幅上行压力等。展望一季度,中小创短期可能仍将受压于IPO持续和高估值,但部分成长性良好的股票估值已经回到较低位,具备投资价值,而大盘指数由于宏观流动性压力缓解、经济弱复苏预期等,保持相对强势。结构上,注重低估值的优质蓝筹配置,同时关注改革政策相关的主题和真成长个股。

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0.05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深证100指数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,融通深证100指数证券投资基金的管理人——融通基金管理有限公司在融通深证100指数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,融通深证100指数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22,616,749.08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深证100指数证券投资基金2016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21193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:融通通利系列证券投资基金-融通深证100指数证券投资基金

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	37,577,605.57	324,909,845.32
结算备付金	-	1,264,967.45
存出保证金	114,704.21	949,147.19
交易性金融资产	5,248,603,093.67	6,389,800,509.10
其中:股票投资	4,989,109,493.87	6,189,140,509.10
基金投资	-	-
债券投资	259,493,599.80	200,660,000.00
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	-	-
应收利息	4,797,498.24	5,672,654.08
应收股利	-	-
应收申购款	2,687,921.88	4,434,256.21
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	5,293,780,823.57	6,727,031,379.35
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	-	130,510,243.19
应付赎回款	4,863,014.96	11,476,648.79
应付管理人报酬	4,613,717.96	5,588,614.28
应付托管费	922,743.62	1,117,722.86
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	656,254.51	978,240.06
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	934,356.22	1,215,739.91
负债合计	11,990,087.27	150,887,209.09
所有者权益:		
实收基金	4,265,907,259.80	4,491,004,301.60
未分配利润	1,015,883,476.50	2,085,139,868.66
所有者权益合计	5,281,790,736.30	6,576,144,170.26
负债和所有者权益总计	5,293,780,823.57	6,727,031,379.35

注:报告截止日2016年12月31日,基金份额净值1.238元,基金份额总额4,265,907,259.80份。

7.2 利润表

会计主体:融通通利系列证券投资基金-融通深证100指数证券投资基金

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	-927,867,658.59	3,341,017,749.83
1.利息收入	4,269,984.17	13,644,135.09
其中:存款利息收入	1,805,067.57	1,780,460.71
债券利息收入	2,461,979.41	11,863,674.38
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,937.19	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益	55,643,293.57	3,936,528,939.10
其中:股票投资收益	-34,226,730.80	3,849,199,901.35
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-46,600.00	-67,463.70
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	89,916,624.37	87,396,501.45
3.公允价值变动收益	-988,297,752.86	-611,547,639.46
4.汇兑收益	-	-
5.其他收入	516,816.53	2,392,315.10
减:二、费用	68,965,430.46	129,723,566.00
1. 管理人报酬	53,968,828.52	90,581,467.43
2. 托管费	10,793,765.65	18,116,293.53
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	3,833,859.94	20,636,646.13
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	368,976.35	389,158.91
三、利润总额	-996,833,089.05	3,211,294,183.83
减:所得税费用	-	-
四、净利润	-996,833,089.05	3,211,294,183.83

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:融通通利系列证券投资基金-融通深证100指数证券投资基金

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)	4,491,004,301.60	2,085,139,868.66	6,576,144,170.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-996,833,089.05	-996,833,089.05
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-225,097,041.80	-49,806,554.03	-274,903,595.83
其中:1.基金申购款	973,918,323.65	209,034,958.06	1,182,953,281.71
2.基金赎回款	-1,199,015,365.45	-258,841,512.09	-1,457,856,877.54
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-22,616,749.08	-22,616,749.08
五、期末所有者权益(基金净值)	4,265,907,259.80	1,015,883,476.50	5,281,790,736.30
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)	10,295,056,352.40	2,181,921,249.12	12,476,977,601.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,211,294,183.83	3,211,294,183.83
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-5,804,052,050.80	-3,308,075,564.29	-9,112,127,615.09
其中:1.基金申购款	2,161,922,381.58	833,084,031.39	2,995,006,412.97
2.基金赎回款	-7,965,974,432.38	-4,141,159,595.68	-12,107,134,028.06
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)	4,491,004,301.60	2,085,139,868.66	6,576,144,170.26

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

本基金本报告期内无会计政策变更。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计变更。

7.4.2 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。

7.4.3 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("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

本基金本报告期及上年度可比期间均未租用关联方的交易单元。

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	53,968,828.52	90,581,467.43
其中:支付销售机构的客户维护费	6,943,277.90	11,169,567.59

注:1.支付基金管理人融通基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值1.00%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×1.00%÷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	10,793,765.65	18,116,293.53

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0.20%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:日基金托管费=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

本报告期及上年度可比期间本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

本基金本报告期末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。

7.4.4.5 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	37,577,605.57	1,720,955.49	324,909,845.32	1,559,707.40

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

本基金本期未无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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
300104	乐视网	2016-12-07	重大资产重组	35.80	2017-01-16	36.88	1,993,552	40,216,370.27	71,369,161.60
000166	申万宏源	2016-12-21	重大事项	6.25	2017-01-26	6.29	10,468,476	126,778,578.44	65,427,975.00
000540	中天城投	2016-11-28	重大资产重组	6.93	2017-01-03	7.00	4,347,700	36,294,382.79	30,129,561.00
000750	国海证券	2016-12-15	重大事项	6.97	2017-01-20	6.27	3,876,850	25,462,385.94	27,021,644.50
002129	中环股份	2016-04-25	重大事项	8.27	-	-	2,833,400	31,630,265.63	23,432,218.00

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

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购,因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

§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	4,989,109,493.87	94.24
	其中:股票	4,989,109,493.87	94.24
2	固定收益投资	259,493,599.80	4.90
	其中:债券	259,493,599.80	4.90
	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	37,577,605.57	0.71
7	其他各项资产	7,600,124.33	0.14
8	合计	5,293,780,823.57	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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	16,984,351.92	0.32
B	采矿业	27,384,123.24	0.52
C	制造业	2,775,631,868.04	52.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	62,818,618.01	1.19
F	批发和零售业	92,082,193.85	1.74
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	565,018,069.65	10.70
J	金融业	690,438,802.81	13.07
K	房地产业	419,445,003.22	7.94
L	租赁和商务服务业	49,463,516.46	0.94
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	135,802,395.70	2.57
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	113,018,069.33	2.14
S	综合	41,022,481.64	0.78
	合计	4,989,109,493.87	94.46

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合本基金本报告期末无积极投资部分股票。

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

1.1.1 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(%)
1	000002	万 科A	12,468,800	256,233,840.00	4.85
2	000651	格力电器	10,021,339	246,725,366.18	4.67
3	000333	美的集团	6,850,082	192,966,809.94	3.65
4	000001	平安银行	16,668,221	151,680,811.10	2.87
5	000858	五 粮 液	3,830,039	132,059,744.72	2.50
6	000725	京东方A	42,962,467	122,872,655.62	2.33
7	000776	广发证券	6,353,656	107,122,640.16	2.03
8	002415	海康威视	3,969,612	94,516,461.72	1.79
9	002024	苏宁云商	8,042,113	92,082,193.85	1.74
10	002450	康得新	4,498,302	85,962,551.22	1.63

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。

1.1.2 期末积极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

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

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	000725	京东方A	58,556,645.00	0.89
2	002466	天齐锂业	55,855,606.74	0.85
3	002183	怡 亚 通	43,827,302.12	0.67
4	002252	上海莱士	39,955,685.49	0.61
5	002460	赣锋锂业	34,326,486.18	0.52
6	002176	江特电机	32,656,205.34	0.50
7	300072	三聚环保	31,777,812.34	0.48
8	002007	华兰生物	30,696,727.99	0.47
9	002310	东方园林	30,631,728.40	0.47
10	000938	紫光股份	30,327,453.92	0.46
11	002610	爱康科技	30,269,932.12	0.46
12	002407	多氟多	30,178,708.68	0.46
13	002797	第一创业	30,145,386.97	0.46
14	002340	格林美	30,141,467.34	0.46
15	002736	国信证券	30,063,068.70	0.46
16	000983	西山煤电	30,057,411.55	0.46
17	002709	天赐材料	29,705,848.53	0.45
18	000988	华工科技	28,075,053.69	0.43
19	002673	西部证券	26,580,313.73	0.40
20	000540	中天城投	26,094,535.51	0.40

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

1.2.2 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(%) |
|---|---|---|---