# 融通动力先锋股票型证券投资基金

## 2013 年度 报告摘要

2013年12月31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
送出日期:2014年3月27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动力先锋股票型证券投资基金(以下简称"本基金")基金合同规定,于2014年3月20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2013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 | 融通动力先锋股票 |
| 基金主代码 | 161609 |
| 前端交易代码 | 161609 |
| 后端交易代码 | 161659 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2006年11月15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 | 1,912,960,238.06份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金为主动式股票型基金,主要投资于制造业和服务行业中价值暂时被市场低估的股票,分享中国工业化深化过程中两大推动经济增长的引擎—"制造业(特别是装备制造业)和服务业(特别是现代服务业)"的高速成长,力争在控制风险并保持良好流动性的前提下,追求稳定的、优于业绩基准的回报,为投资者实现基金资产稳定且丰厚的长期资本增值。 |
| 投资策略 | 价值低估和业绩增长是推动股价上涨的核心动力。在股价波动与上市公司基本面相关性日益密切的资本市场上,投资于推动经济增长的主要产业部门,可分享该产业部门成长性持续优于经济整体水平而获得的较为显著的超额收益。我们相信,在中国工业化深化阶段,作为经济主要推动力的制造业(特别是装备制造业)和服务业(特别是现代服务业),将是高速发展的产业领域,其增长速度将持续高于GDP增长速度。这两个行业中的价值成长型上市公司兼具良好的盈利性和成长性,长期成长前景良好,代表着中国经济增长的方向,是推动经济增长的中坚力量。本基金通过投资于制造业和服务业两大领域中价值暂时被市场低估的股票,分享中国经济和资本市场高速成长红利,获取丰厚的资产增值机会。 |
| 业绩比较基准 | 2013年6月30日之前(含此日):富时中国A600指数收益率×80%+新华巴克莱资本中国金债指数收益率×20%;<br>2013年7月1日起:沪深300指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20% |
| 风险收益特征 | 属高风险高收益产品。 |

注:富时中国A600指数即原新华富时A600指数。

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 | 赵会军 |
| | 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 | 2013年 | 2012年 | 2011年 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | 302,976,476.45 | -203,005,637.73 | -439,002,172.68 |
| 本期利润 | 379,045,825.92 | 47,341,377.56 | -834,916,541.81 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.2012 | 0.0246 | -0.4052 |
| 本期基金份额净值增长率 | 21.36% | 2.62% | -30.77% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2013年末 | 2012年末 | 2011年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.1632 | -0.3243 | -0.2185 |
| 期末基金资产净值 | 2,183,717,533.17 | 1,752,361,795.59 | 1,819,395,020.19 |
| 期末基金份额净值 | 1.142 | 0.941 | 0.917 |

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;

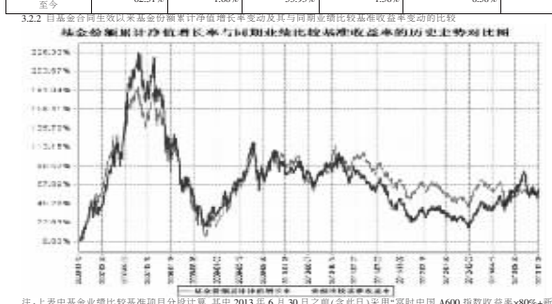
3.期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额,其中期末可供分配利润:如果期末未分配利润的未实现部分为正数,期期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

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

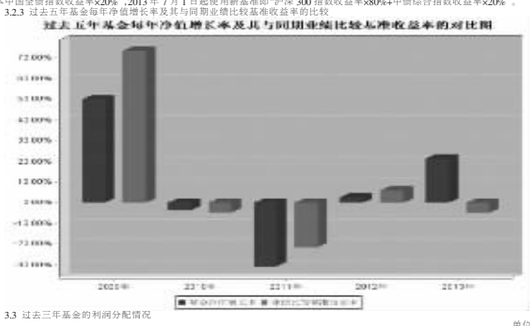
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -9.22% | 1.62% | -3.10% | 0.90% | -6.12% | 0.72% |
| 过去六个月 | 14.89% | 1.63% | 3.88% | 1.03% | 11.01% | 0.60% |
| 过去一年 | 21.36% | 1.54% | -4.98% | 1.10% | 26.34% | 0.44% |
| 过去三年 | -13.79% | 1.31% | -21.24% | 1.06% | 7.45% | 0.25% |
| 过去五年 | 24.15% | 1.42% | 29.96% | 1.24% | -5.81% | 0.18% |
| 目基金合同生效起至今 | 62.51% | 1.68% | 53.93% | 1.56% | 8.58% | 0.12% |

3.2.2 目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:上表中基金业绩比较基准项目分段计算,其中2013年6月30日之前(含此日)采用"富时中国A600指数收益率×80%+新华巴克莱资本中国金债指数收益率×20%",2013年7月1日起使用新基准期"沪深300指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%"。

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 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2013 | - | - | - | - | - |
| 2012 | - | - | - | - | - |
| 2011 | 0.250 | 16,661,994.85 | 37,315,487.69 | 53,977,482.54 | - |
| 合计 | 0.250 | 16,661,994.85 | 37,315,487.69 | 53,977,482.54 | - |

### §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:新时代证券有限责任公司60%、日兴资产管理有限公司(Nikko Asset Management Co., Ltd.)40%。

截至2013年12月31日,公司管理的基金共有二十四只:一只封闭式基金,即融通通乾封闭基金;二十三只开放式基金,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、融通领先成长股票基金(LOF)、融通内需驱动股票基金、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、融通医疗保健行业股票基金、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、融通通泽一年目标触发式混合基金、融通通祥一年目标触发式混合基金、融通通程一年目标触发式混合基金、融通通利债券基金和融通通源一年目标触发式混合基金。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 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 郭恒 | 本基金的基金经理 | 2011年3月24日 | - | 17 | 硕士学位,具有证券从业资格,自1997年9月进入证券行业,先后任职南方证券投资银行高级经理、君安证券投资银行业务董事、中国服装股份有限公司常务副总经理、华泰投资公司高级研究员、2007年6月至2010年7月任职华商基金管理有限公司研究部副总监,2010年11月进入融通基金管理有限公司。 |

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

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《融通动力先锋股票型证券投资基金基金合同》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。基金投资报告符合有关法律、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控制。

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

2013年上证指数全年下跌6.75%,沪深300指数全年下跌7.65%,中证500指数上涨16.89%,中小板指数上涨17.54%,创业板指数上涨82.73%。2013年市场风格特征明显,以文化传媒、信息服务为主的创业板表现大超市场预期,而金融地产为主沪深300和上证指数全年表现为负收益,结构性行情主导了全年,从市场细分行业结构来看,2013年涨幅排名前五位的申万行业为:信息服务(78.45%)、信息设备(51.66%)、电子(42.78%)、采掘电器(39.33%)、医药生物(36.56%)。跌幅前五位的行业为:采掘(-31.18%)、有色金属(-29.64%)、黑色金属(-17.27%)、房地产(-11.94%)、建筑建材(-10.82%)。

2013年中国经济政策面维调调结构和稳增长,进一步进行市场化改革,特别是利率市场化,央行货币政策上坚定推进利率市场化;金融机构法权化,此举推升了短期市场利率。十一月份十八届三中全会对中国中长期发展和改革作了全面论述并勾画出更伟蓝图,增强了境内外投资者对中国未来经济增长的信心。中国经济面临主要问题是高房价、人口老龄化、生产要素市场化不足,政府对经济调观活动管控过度等等。本基金报告期内在投资策略上高度关注中国经济基本面的变化,坚持价值投资理念,基金组合配置上主要以成长股为主,重点配置行业位息服务与设备、医药生物、大众消费、高端装备和环保等。

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21.36%,同期业绩比较基准收益率为-4.98%。

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2014年,本基金认为中国经济基本面与2013年差异不大,仍然还是房地产调控,去过剩产能,金融去杠杆,促进转型升级。2014年政府将贯彻落实十八届三中全会精神,进一步深化改革建立和谐社会,转变地方政府职能,改变原来片面追求GDP增速,重视民生需求,建立完善社保医疗体系,改善居住环境等。地方政府职能转变也将改变中国经济发展模式和增速。地方政府债务短期会成为隐忧,金融去杠杆可能带来经济下滑和流动性紧张风险,与宏观经济增速相关性强的传统周期行业会面临更大的压力,相对而言服务业会进入黄金发展时期,值得重视的是移动互联网在改变人类生产和生活,对各行各业的渗透,改变原有的商业模式和提高效率,从股票市场投资来看,2014年中国经济转型升级为行度会大大强于前几年,传统的经济增长模式将发生彻底转变,服务业发展的黄金时期,本基金将高度重视服务业带来的投资机会,特别是与移动互联网相关的投资机会,与民生相关的大众消费投资机会,外需改善带来的出口型企业投资机会,关注部分传统行业去产能后带来基本面好转的投资机会。

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需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,最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

截至报告期末,本基金每份基金份额可供分配利润-0.1632元,依据合同约定,暂不进行利润分配。

### §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动力先锋股票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,融通动力先锋股票型证券投资基金的管理人——融通基金管理有限公司在融通动力先锋股票型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,融通动力先锋股票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动力先锋股票型证券投资基金2013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2013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(2014)第21285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:融通动力先锋股票型证券投资基金

报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

| 资 产 | 本期末 2013年12月31日 | 上年度末 2012年12月31日 |
|---|---|---|
| 资 产: | | |
| 银行存款 | 80,197,375.67 | 182,630,868.98 |
| 结算备付金 | 16,310,509.28 | 3,029,907.65 |
| 存出保证金 | 2,250,541.10 | 1,750,000.00 |
| 交易性金融资产 | 2,115,968,418.98 | 1,634,811,839.96 |
| 其中:股票投资 | 2,014,293,309.58 | 1,532,558,430.36 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 101,675,109.40 | 102,253,409.60 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 49,958,224.98 | - |
| 应收证券清算款 | - | 10,917,483.80 |
| 应收利息 | 914,555.42 | 592,565.52 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 126,222.24 | 134,375.15 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 2,265,725,847.67 | 1,833,867,041.06 |

| 负债和所有者权益 | 本期末 2013年12月31日 | 上年度末 2012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 | 66,771,282.62 | 74,095,648.94 |
| 应付赎回款 | 2,683,130.04 | 1,009,257.42 |
| 应付管理人报酬 | 2,870,659.12 | 2,068,305.19 |
| 应付托管费 | 478,443.20 | 344,717.53 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 8,000,014.30 | 2,632,359.22 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 1,204,785.22 | 1,354,957.17 |
| 负债合计 | 82,008,314.50 | 81,505,245.47 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 1,912,960,238.06 | 1,861,322,722.64 |
| 未分配利润 | 270,757,295.11 | -108,960,927.05 |
| 所有者权益合计 | 2,183,717,533.17 | 1,752,361,795.59 |
| 负债和所有者权益总计 | 2,265,725,847.67 | 1,833,867,041.06 |

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.142元,基金份额总额1,912,960,238.06份。

7.2 利润表

会计主体:融通动力先锋股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

| 项 目 | 本期 2013年1月1日至2013年12月31日 | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | 448,186,650.65 | 96,181,749.60 |
| 1.利息收入 | 5,208,172.08 | 5,064,361.53 |
| 其中:存款利息收入 | 1,615,957.69 | 1,611,010.05 |
| 债券利息收入 | 3,335,448.44 | 3,368,897.95 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 256,765.95 | 84,453.53 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益 | 366,557,431.85 | -159,306,129.90 |
| 其中:股票投资收益 | 354,873,655.71 | -177,124,965.52 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 375,972.39 | 14,500.00 |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 11,307,803.75 | 17,804,335.62 |
| 3.公允价值变动收益 | 76,069,349.47 | 250,347,015.29 |
| 4.汇兑收益 | - | - |
| 5.其他收入 | 351,697.25 | 76,502.68 |
| 减:二、费用 | 69,140,824.73 | 48,840,372.04 |
| 1.管理人报酬 | 30,254,773.94 | 26,683,791.86 |
| 2.托管费 | 5,042,462.28 | 4,447,298.65 |
| 3.销售服务费 | - | - |
| 4.交易费用 | 33,419,014.55 | 17,288,799.40 |
| 5.利息支出 | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6.其他费用 | 424,573.96 | 420,482.13 |
| 三、利润总额 | 379,045,825.92 | 47,341,377.56 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润 | 379,045,825.92 | 47,341,377.56 |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:融通动力先锋股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013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) | 1,861,322,722.64 | -108,960,927.05 | 1,752,361,795.59 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 379,045,825.92 | 379,045,825.92 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 | 51,637,515.42 | 672,396.24 | 52,309,911.66 |
| 其中:1.基金申购款 | 434,514,339.25 | 36,532,149.96 | 471,046,489.21 |
| 2.基金赎回款 | -382,876,823.83 | -35,859,753.72 | -418,736,577.55 |
| 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) | 1,912,960,238.06 | 270,757,295.11 | 2,183,717,533.17 |

| 项目 | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012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) | 1,984,058,268.32 | -164,663,248.13 | 1,819,395,020.19 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 47,341,377.56 | 47,341,377.56 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 | -122,735,545.68 | 8,360,943.52 | -114,374,602.16 |
| 其中:1.基金申购款 | 24,543,766.97 | -1,483,151.04 | 23,060,615.93 |
| 2.基金赎回款 | -147,279,312.65 | 9,844,094.56 | -137,435,218.09 |
| 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) | 1,861,322,722.64 | -108,960,927.05 | 1,752,361,795.59 |

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:

奚星华　　朱建华　　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

本基金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一致。

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("中国工商银行") | 基金托管人、基金代销机构 |
| 新时代证券有限责任公司("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。

7.4.4 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 2013年1月1日至2013年12月31日 | | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012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 | 1,533,367,261.47 | 6.93% | 1,503,671,243.06 | 13.23% |

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 2013年1月1日至2013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 | 1,395,976.91 | 7.04% | 1,141,249.26 | 14.27% |

| 关联方名称 | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012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 | 1,296,479.96 | 13.21% | 231,094.22 | 8.78% |

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后的净额列示。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 2013年1月1日至2013年12月31日 | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 30,254,773.94 | 26,683,791.86 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 5,172,492.91 | 5,027,115.72 |

注:1.支付基金管理人融通基金管理有限公司的基金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:

日基金管理人报酬=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 2013年1月1日至2013年12月31日 | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 5,042,462.28 | 4,447,298.65 |

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0.25%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。

7.4.4.3 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 2013年1月1日至2013年12月31日 | | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012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 | 80,197,375.67 | 1,332,309.10 | 182,630,868.98 | 1,530,580.91 |

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、托管人的股票投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

本基金无其他关联交易事项的说明。

7.4.5 期末(2013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 |
| 600633 | 浙报传媒 | 2013年4月24日 | 2014年4月22日 | 非公开发行流通受限 | 13.90 | 25.41 | 1,720,000 | 23,908,000.00 | 43,705,200.00 | - |
| 002106 | 莱宝高科 | 2013年3月18日 | 2014年3月19日 | 非公开发行流通受限 | 16.52 | 11.55 | 1,000,000 | 16,520,000.00 | 11,550,000.00 | - |

注:基金可作为转定投资者,认购由中国证监会(上市公司证券发行管理办法)规范的非公开发行股票,所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告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 | 2,014,293,309.58 | 88.90 |
| | 其中:股票 | 2,014,293,309.58 | 88.90 |
| 2 | 固定收益投资 | 101,675,109.40 | 4.49 |
| | 其中:债券 | 101,675,109.40 | 4.49 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | 49,958,224.98 | 2.20 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 96,507,884.95 | 4.26 |
| 6 | 其他各项资产 | 3,291,318.76 | 0.15 |
| 7 | 合计 | 2,265,725,847.67 | 100.00 |

8.2 报告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 | 157,000,183.32 | 7.19 |
| C | 制造业 | 1,239,743,169.35 | 56.77 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 63,738,161.20 | 2.92 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| 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 | 383,241,263.79 | 17.55 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 4,839,777.36 | 0.22 |
| 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 | 72,436,462.26 | 3.32 |
| 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 | 93,294,292.30 | 4.27 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 2,014,293,309.58 | 92.24 |

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 | 600527 | 江南高纤 | 18,345,856 | 128,054,074.88 | 5.86 |
| 2 | 600570 | 恒生电子 | 4,574,564 | 95,425,405.04 | 4.37 |
| 3 | 600587 | 新华医疗 | 1,255,162 | 87,748,375.42 | 4.02 |
| 4 | 300145 | 南方泵业 | 2,304,285 | 86,756,330.25 | 3.97 |
| 5 | 002567 | 唐人神 | 9,168,892 | 86,462,651.56 | 3.96 |
| 6 | 000661 | 长春高新 | 754,343 | 81,997,084.10 | 3.75 |
| 7 | 002683 | 宏大爆破 | 2,608,700 | 81,600,136.00 | 3.74 |
| 8 | 300300 | 汉鼎股份 | 4,123,522 | 80,656,090.32 | 3.69 |
| 9 | 300164 | 通源石油 | 4,566,932 | 75,400,047.32 | 3.45 |
| 10 | 002501 | 利源精制 | 5,274,257 | 73,892,340.57 | 3.38 |
| 11 | 600637 | 百视通 | 202,628,630.13 | 11.56 |
| 12 | 300133 | 华策影视 | 170,393,791.41 | 9.72 |
| 13 | 600804 | 鹏博士 | 156,820,695.22 | 8.95 |
| 14 | 300059 | 东方财富 | 150,584,219.30 | 8.59 |
| 15 | 601299 | 中国北车 | 144,054,706.49 | 8.22 |
| 16 | 600837 | 海通证券 | 143,606,399.99 | 8.20 |
| 17 | 300104 | 乐视网 | 131,102,060.29 | 7.48 |
| 18 | 603000 | 人民网 | 124,470,345.58 | 7.10 |
| 19 | 000002 | 万 科A | 123,763,305.15 | 7.06 |
| 20 | 300164 | 通源石油 | 117,277,316.74 | 6.69 |
| 21 | 300055 | 万邦达 | 113,594,395.02 | 6.48 |
| 22 | 600527 | 江南高纤 | 112,822,204.54 | 6.44 |
| 23 | 601318 | 中国平安 | 109,619,078.54 | 6.26 |
| 24 | 600525 | 长园集团 | 109,473,343.27 | 6.25 |
| 25 | 300079 | 数码视讯 | 108,313,734.42 | 6.18 |
| 26 | 600316 | 洪都航空 | 107,573,485.97 | 6.14 |
| 27 | 002482 | 广田股份 | 105,544,311.61 | 6.02 |
| 28 | 002368 | 太极股份 | 104,293,644.62 | 5.95 |
| 29 | 000661 | 