

融通通祥 年目标触发式灵活配置型证券投资基金清算报告

5.1 重要提示

1.1 重要提示
融通通祥年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会证监基金[2013]1071号文准予注册募集,2013年10月22日依法正式运作。
根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《融通通祥年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)的有关规定,本基金在1年的运作期满后进入基金财产清算并终止(基金合同)。本基金基金合同终止及基金财产清算的公告详见在2014年10月21日《中国证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站(www.fundfund.com)上的《关于融通通祥年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。
于2014年10月22日,本基金最长封闭期的最后一日(基金到期日),由本基金管理人融通基金管理有限公司委托普华永道中国建设银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所有限公司(特殊普通合伙)和广东惠得律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由普华永道中天会计师事务所有限公司(特殊普通合伙)对清算报告进行审计,广东惠得律师事务所对清算报告出具法律意见。

5.2 基金概况

基金名称	融通通祥年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	融通通祥年目标触发式混合
基金代码	000315
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日期	2013年10月22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
基金合同期限	本基金合同期限,最长封闭期为一年

2.1 基金基本情况
本基金在追求基金安全的基础上,通过大类资产配置与个股选择,采用数量化手段进行资产配置,有效控制回撤,力争实现长期稳健增值。本基金采用“自上而下”与“自下而上”相结合主动投资管理策略,将证券大类资产配置与个股选择相结合,在控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期增值。
本基金采用“自上而下”与“自下而上”相结合主动投资管理策略,将证券大类资产配置与个股选择相结合,在控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期增值。
本基金采用“自上而下”与“自下而上”相结合主动投资管理策略,将证券大类资产配置与个股选择相结合,在控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期增值。

5.3 基金运作情况概述

本基金经中国证监会证监基金[2013]1071号文准予注册募集,由基金管理人融通基金管理有限公司于2013年9月16日至2013年10月18日向社会公开发行募集,基金合同于2013年10月22日正式生效,截至2014年9月30日,本基金资产净值为640,543,966.41份基金份额。
本基金管理人在2014年10月15日公告《融通通祥年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金基金合同》,自10月15日起,本基金份额分红0.37元,收益分配金额为2014年10月13日,现金红利发放为2014年10月21日,在红利发放总额33,700,127.03元。
根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《基金合同》的有关规定,本基金在1年的运作期满后进入基金财产清算并终止(基金合同)。本基金于2014年10月23日进入变现并清算期。

5.4 审计报告

普华永道中天特字(2014)第1569号融通基金管理有限公司
我们审计了后附的融通通祥年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“融通通祥混合基金”)的财务报表,包括2014年10月22日(基金到期日)的资产负债表、2014年1月1日至2014年10月22日(基金到期日)期间的利润表,所有者权益变动表和财务报表附注(以下简称“财务报表”)。财务报表已由融通基金管理有限公司(以下简称“贵公司”)管理层按照附注所述的会计政策及会计估计编制。
我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计程序。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范,计划和实施审计程序以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。
审计工作涉及选择恰当的审计程序,以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估,在进行风险评估时,我们考虑与财务报表编制相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。
我们相信,我们的审计为财务报表是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
我们认为,上述财务报表已经在所有重大方面按照附注所述的财务报表附注所述的编制基础编制财务报表附注的重要会计政策和会计估计披露。
四、强调事项
我们提醒财务报表使用者关注,如本财务报表的财务报表附注所述,融通通祥混合基金最长封闭期于2014年10月22日到期,根据《融通通祥年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及《融通通祥年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金基金合同》,融通通祥混合基金基金合同于2014年10月21日到期,融通通祥混合基金基金合同于2014年10月23日进入变现并清算程序,本段内容不影响已发表的审计意见。
五、编制财务报表时使用的限制
我们提醒财务报表使用者关注,本财务报表的财务报表附注所述的编制基础,管理人根据《融通通祥年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定编制财务报表,因此本财务报表的财务报表可能不适用于其他用途。本报告仅供管理人融通通祥混合基金进行财产清算时以及管理人向中国证券监督管理委员会及其派出机构报送使用,不得用于其他目的。本段内容不影响已发表的审计意见。
普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 汪 虹 注册会计师
中国·上海市 王 爽 注册会计师

5.5 财务报表

资产负债表:融通通祥年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金基金合同终止,2014年10月22日(基金到期日) 单位:人民币元

资产	附注	2014年10月22日	2013年12月31日
银行存款	5.4.5.1	618,283,816.45	353,145,543.69
结算备付金		24,596,237.68	22,985,572.16
应收利息		609,368.26	90,968.28
买入返售金融资产	5.4.5.2	40,287,383.63	1,809,300.07
其他应收款		264,697,739.56	-
预付款项	5.4.5.3	97,962.89	808,351.02
应收股利		643,927,482.28	641,679,112.78
其他流动资产		-	396,700.00
资产总计		1,336,662.79	1,336,662.79
应付账款	5.4.5.4	2,097.29	875,765.58
预收款项	5.4.5.5	3,795,600.00	121,000.00
应付利息		37,762.89	932,483.31
应付股利		-	-
其他流动负债		-	-
负债合计		6,155.18	1,899,253.91
所有者权益		1,330,507.61	1,330,408.88
实收基金	5.4.5.6	640,543,966.41	640,543,966.41
未分配利润	5.4.5.7	689,963.20	689,842.47
所有者权益合计		1,330,507.61	1,330,408.88
负债和所有者权益总计		1,336,662.79	1,336,662.79

注:报告期末于2014年10月22日,基金份额净值1.005元,自2014年10月22日(基金合同终止日)以来的基金份额累计净值1.042元,基金份额总额640,543,966.41份。
资产负债表:融通通祥年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金基金合同终止,2014年1月1日至2014年10月22日(基金到期日)期间 单位:人民币元

项目	附注	2014年1月1日至2014年10月22日(基金到期日)	2013年10月22日(基金到期日)
一、收入			
利息收入		8,173,403.15	2,986,548.67
其中:存款利息收入	5.4.5.8	4,459,928.82	1,753,000.67
债券利息收入		3,713,474.33	1,233,547.99
股利收入		2,965,764.24	1,333,490.60
公允价值变动损益(计入“公允价值变动损益”)		34,876,368.04	-3,989,471.31
其他业务收入	5.4.5.9	32,700,625.15	-3,999,871.31
其他杂项收入		54,911.99	200,000.00
公允价值变动损益(计入“公允价值变动损益”)	5.4.5.11	-2,075,263.53	-
公允价值变动损益(计入“公允价值变动损益”)	5.4.5.12	-2,781,826.72	2,781,826.72
其他收入(计入“公允价值变动损益”)	5.4.5.13	13,764,693.14	876,179.00
资产减值损失		-	-
管理费用	5.4.7.1	1,288,709.43	306,638.52
销售费用	5.4.7.2	22,176,912.20	1,170,761.28
其他费用	5.4.7.3	309,240.43	123,275.76
二、期间费用合计(计入“公允价值变动损益”)		26,501,191.97	202,680.04
期间费用合计(计入“公允价值变动损益”)		26,501,191.97	202,680.04

5.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:融通通祥年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金

(上接B114版)

4.1) 决策能力:本基金从企业管理层能力、制衡机制、组织结构和激励机制等方面进行公司管理能力的分析,管理能力不仅包括公司治理和内部控制,更要强调法律意识和道德修养。
4.2) 债券投资策略:本基金在追求基金安全的基础上,通过大类资产配置与个股选择,采用数量化手段进行资产配置,有效控制回撤,力争实现长期稳健增值。
4.3) 风险控制:本基金在追求基金安全的基础上,通过大类资产配置与个股选择,采用数量化手段进行资产配置,有效控制回撤,力争实现长期稳健增值。
4.4) 估值:本基金在追求基金安全的基础上,通过大类资产配置与个股选择,采用数量化手段进行资产配置,有效控制回撤,力争实现长期稳健增值。
4.5) 风险管理:本基金在追求基金安全的基础上,通过大类资产配置与个股选择,采用数量化手段进行资产配置,有效控制回撤,力争实现长期稳健增值。
4.6) 信息披露:本基金在追求基金安全的基础上,通过大类资产配置与个股选择,采用数量化手段进行资产配置,有效控制回撤,力争实现长期稳健增值。
4.7) 基金管理人:融通通祥年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金基金合同终止,2014年1月1日至2014年10月22日(基金到期日)期间 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	318,908,639.94	31.26
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	21,378,407.57	2.10
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	236,347,779.60	23.17
J	金融业	-	-
K	房地产业	22,652,597.28	2.22
L	租赁和商务服务业	83,799,077.10	8.22
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	61,262,221.92	6.01
O	教育、文体和娱乐业	-	-
P	卫生和社会工作	22,176,912.20	2.17
R	文化、体育和娱乐业	62,909,655.53	6.18
S	综合	-	-
	合计	829,516,296.14	81.32

3.报告期未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
2014年6月30日

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	002638	鹏盛光电	4,430,484	65,881,297.08	6.46
2	200291	华荣化工	1,197,117	62,909,655.53	6.18
3	300144	宋城演艺	2,304,212	61,262,221.92	6.01
4	002773	鹏欣资源	2,590,085	61,126,060.00	5.99
5	300178	腾信股份	3,218,890	52,419,809.20	5.14
6	300183	东软集团	1,439,634	51,826,240.00	5.08
7	300116	福晶科技	2,207,797	40,836,358.41	4.00
8	300113	顺网科技	1,386,121	35,544,128.20	3.29
9	300059	东方财富	2,200,000	26,466,000.00	2.59
10	000041	深长城	2,613,228	26,028,358.44	2.55

4.报告期未按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末持有债券:
5.期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
本基金本报告期末持有债券:
6.期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末持有资产支持证券:
7.报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末持有贵金属:
8.报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证投资:
9.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有股指期货:
9.2.本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末未持有股指期货:
10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货:
10.1.本期国债期货交易政策
根据本基金基金合同约定,本基金的投资范围不包括国债期货。
10.2.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货:
10.3.本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货:
10.4.本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货:
注:①本基金合同生效日为2014年3月18日,截至本报告期末,本基金合同生效未满一年。

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

信息披露日期:2014年10月31日

本报告期:2014年1月1日至2014年10月22日(基金到期日)止期间

项目	2014年1月1日至2014年10月22日(基金到期日)	2013年12月31日
一、期初所有者权益(基金净值)	640,543,966.41	202,680.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	202,680.04
三、本期基金份额持有人申购资金变动数(净额)	-	-
其中:1.基金申购款	-	-
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-	-
四、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数(净额)	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	640,543,966.41	202,680.04
六、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	202,680.04
七、本期基金份额持有人申购资金变动数(净额)	-	-
其中:1.基金申购款	-	-
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-	-
八、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数(净额)	-	-
九、期末所有者权益(基金净值)	640,543,966.41	202,680.04
十、期初所有者权益(基金净值)	640,543,966.41	202,680.04
十一、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	202,680.04
十二、本期基金份额持有人申购资金变动数(净额)	-	-
其中:1.基金申购款	-	-
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-	-
十三、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数(净额)	-	-
十四、期末所有者权益(基金净值)	640,543,966.41	202,680.04

以下报表附注为财务报表的组成部分。

5.4 报表附注

5.4.1 基金基本情况
融通通祥年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会证监基金[2013]1071号文准予注册募集,2013年10月22日依法正式运作。
根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《融通通祥年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)的有关规定,本基金在1年的运作期满后进入基金财产清算并终止(基金合同)。本基金于2014年10月23日进入变现并清算期。
普华永道中天特字(2014)第1569号融通基金管理有限公司
我们审计了后附的融通通祥年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“融通通祥混合基金”)的财务报表,包括2014年10月22日(基金到期日)的资产负债表、2014年1月1日至2014年10月22日(基金到期日)期间的利润表,所有者权益变动表和财务报表附注(以下简称“财务报表”)。财务报表已由融通基金管理有限公司(以下简称“贵公司”)管理层按照附注所述的会计政策及会计估计编制。
我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计程序。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范,计划和实施审计程序以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。
审计工作涉及选择恰当的审计程序,以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估,在进行风险评估时,我们考虑与财务报表编制相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。
我们相信,我们的审计为财务报表是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
我们认为,上述财务报表已经在所有重大方面按照附注所述的财务报表附注所述的编制基础编制财务报表附注的重要会计政策和会计估计披露。
四、强调事项
我们提醒财务报表使用者关注,如本财务报表的财务报表附注所述,融通通祥混合基金最长封闭期于2014年10月22日到期,根据《融通通祥年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及《融通通祥年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金基金合同》,融通通祥混合基金基金合同于2014年10月21日到期,融通通祥混合基金基金合同于2014年10月23日进入变现并清算程序,本段内容不影响已发表的审计意见。
五、编制财务报表时使用的限制
我们提醒财务报表使用者关注,本财务报表的财务报表附注所述的编制基础,管理人根据《融通通祥年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定编制财务报表,因此本财务报表的财务报表可能不适用于其他用途。本报告仅供管理人融通通祥混合基金进行财产清算时以及管理人向中国证券监督管理委员会及其派出机构报送使用,不得用于其他目的。本段内容不影响已发表的审计意见。
普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 汪 虹 注册会计师
中国·上海市 王 爽 注册会计师

注:报告期末于2014年10月22日,基金份额净值1.005元,自2014年10月22日(基金合同终止日)以来的基金份额累计净值1.042元,基金份额总额640,543,966.41份。
资产负债表:融通通祥年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金基金合同终止,2014年10月22日(基金到期日) 单位:人民币元

资产	附注	2014年10月22日	2013年12月31日
银行存款	5.4.5.1	618,283,816.45	353,145,543.69
结算备付金		24,596,237.68	22,985,572.16
应收利息		609,368.26	90,968.28
买入返售金融资产	5.4.5.2	40,287,383.63	1,809,300.07
其他应收款		264,697,739.56	-
预付款项	5.4.5.3	97,962.89	808,351.02
应收股利		643,927,482.28	641,679,112.78
其他流动资产		-	396,700.00
资产总计		1,336,662.79	1,336,662.79
应付账款	5.4.5.4	2,097.29	875,765.58
预收款项	5.4.5.5	3,795,600.00	121,000.00
应付利息		37,762.89	932,483.31
应付股利		-	-
其他流动负债		-	-
负债合计		6,155.18	1,899,253.91
所有者权益		1,330,507.61	1,330,408.88
实收基金	5.4.5.6	640,543,966.41	640,543,966.41
未分配利润	5.4.5.7	689,963.20	689,842.47
所有者权益合计		1,330,507.61	1,330,408.88
负债和所有者权益总计		1,336,662.79	1,336,662.79

注:报告期末于2014年10月22日,基金份额净值1.005元,自2014年10月22日(基金合同终止日)以来的基金份额累计净值1.042元,基金份额总额640,543,966.41份。
资产负债表:融通通祥年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金基金合同终止,2014年1月1日至2014年10月22日(基金到期日)期间 单位:人民币元

项目	附注	2014年1月1日至2014年10月22日(基金到期日)	2013年10月22日(基金到期日)
一、收入			
利息收入		8,173,403.15	2,986,548.67
其中:存款利息收入	5.4.5.8	4,459,928.82	1,753,000.67
债券利息收入		3,713,474.33	1,233,547.99
股利收入		2,965,764.24	1,333,490.60
公允价值变动损益(计入“公允价值变动损益”)		34,876,368.04	-3,989,471.31
其他业务收入	5.4.5.9	32,700,625.15	-3,999,871.31
其他杂项收入		54,911.99	200,000.00
公允价值变动损益(计入“公允价值变动损益”)	5.4.5.11	-2,075,263.53	-
公允价值变动损益(计入“公允价值变动损益”)	5.4.5.12	-2,781,826.72	2,781,826.72
其他收入(计入“公允价值变动损益”)	5.4.5.13	13,764,693.14	876,179.00
资产减值损失		-	-
管理费用	5.4.7.1	1,288,709.43	3