

融通资本通达 12 号专项资产管理计划 2015 年年度报告

【2015-01-20 至 2015-12-31】

第一节 重要提示

本报告依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》（以下简称“《试点办法》”）及其他有关规定制作。

资产管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本专项资产管理计划，但不保证本专项资产管理计划一定盈利，也不保证最低收益。

资产管理人、资产托管人保证本报告书中所载资料的真实性、准确性和完整性。本报告中的财务数据未经审计。

本报告书中的内容由资产管理人负责解释。

本报告书中的金额单位除特指外均为人民币元。

第二节 本计划简介

资管计划基本情况	
产品名称：	融通资本通达 12 号专项资产管理计划（以下简称“本计划”）
成立日期：	2015 年 1 月 20 日
存续期限：	无固定期限
成立规模：	1,861,000,000.00 元
最新的存续规模：	52,689,900,000.00 元
资产管理人：	深圳市融通资本财富管理有限公司
资产托管人：	渤海银行股份有限公司

第三节 本计划基础资产的运作情况

本合同项下委托财产投资范围：企业资产收益权，在投资资金闲置时可将委托资产投资于包括银行存款、大额可转让存单、货币市场基金等在内的流动性管理工具。。资产管理人应当根据本合同确定的投资范围和投资方式进行合理的投资，未经资产委托人和托管人书面同意，不得超越该投资范围。

第四节 本计划资金投资管理运作情况

一、本计划投资运作情况

本报告期，本计划财产按照合同的约定运作正常。

二、本计划报告期末估值表

科目代码	科目名称	数量	单位成本	成本	成本占净值%	市值	市值占净值%
1002	银行存款			7,334,038.31	0.0139	7,334,038.31	0.0139
100201	活期存款			7,334,038.31	0.0139	7,334,038.31	0.0139
10020101	活期存款			7,334,038.31	0.0139	7,334,038.31	0.0139
1303	贷款			22,039,900,000.00	41.8283	22,039,900,000.00	41.8283
130301	普通贷款_贷款			22,039,900,000.00	41.8283	22,039,900,000.00	41.8283
13030101	普通贷款_贷款本金			22,039,900,000.00	41.8283	22,039,900,000.00	41.8283
1503	可供出售金融资产			30,650,000,000.00	58.1689	30,650,000,000.00	58.1689
150312	可供出售金融资产_其他收益权			6,010,000,000.00	11.4060	6,010,000,000.00	11.4060
15031201	可供出售金融资产_其他收益权_成本			6,010,000,000.00	11.4060	6,010,000,000.00	11.4060
150321	可供出售金融资产_其他投资			24,640,000,000.00	46.7629	24,640,000,000.00	46.7629
15032101	可供出售金融资产_其他投资_成本			24,640,000,000.00	46.7629	24,640,000,000.00	46.7629
2207	应付托管费			5,845,404.59	0.0111	5,845,404.59	0.0111
220701	应付托管费			5,845,404.59	0.0111	5,845,404.59	0.0111
证券投资合计:							
其中股票投资:							
其中债券投资:							
其中基金投资:							
其中权证投资:							
今日可用头寸				7,334,038.31	0.01	7,334,038.31	0.01

实收资本金额		52,689,900,000.00	1.00	52,689,900,000.00	100.00	52,689,900,000.00	100.00
实收资本		52,689,900,000.00		52,689,900,000.00	100.00	52,689,900,000.00	100.00
损益平准金_未实现:							
损益平准金_已实现:							
资产类合计:				52,697,234,038.31	100.01	52,697,234,038.31	100.01
负债类合计:				5,845,404.59	0.01	5,845,404.59	0.01
基金资产净值:				52,691,388,633.72	100.00	52,691,388,633.72	100.00
基金单位净值:	1.000			1.000		1.000	

第五节 公平交易、异常交易、业绩表现的专项说明

一、公平交易的专项说明

资产管理人坚持公平对待本计划旗下所有投资组合的原则，并制定了相应的制度和流程，在授权、研究、决策、交易和业绩评估等环节保证公平交易制度的严格执行。本报告期内，资产管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

二、异常交易的专项说明

本报告期内未发生异常交易。

三、本报告期内的业绩表现

本报告期内，本计划正常运行。

第六节 托管人报告

一、本报告期，渤海银行北京分行营业部在本专项资产管理计划的托管过程中，严格遵守了《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、资产管理合同和其他有关规定，不存在损害资产委托人的行为，完全尽职尽责的履行了资产托管人应尽的义务。

二、本托管人在本报告期内依照《试点办法》和《资产管理合同》对本计划的账户资产划转情况、计划资产管理人在资金运作、专项计划费用开支等方面进行了

必要的监督，未发现本计划资产管理人有违反法律法规、《试点办法》的有关规定和《资产管理合同》约定的行为。

三、本托管人认真复核了本计划 2015 年度资产管理报告中的有关内容，以上内容真实、准确和完整。

第七节 其他事项

一、本报告期内，本专项资产管理计划持续经营，未发生违反合同约定的损害基础资产及其收益的情况。

二、本报告期内，本计划资产管理人、资产托管人、投资经理未发生变更，资产管理人及资产托管人未发生任何涉及本计划资产管理人、财产、托管业务的诉讼或监管部门处罚事项。

三、本报告期内，本计划的投资策略、投资决策程序未发生改变。

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询资产管理人深圳市融通资本财富管理有限公司。

地址：广东省深圳市南山区粤海街道深南大道 9678 号大冲商务中心 1 栋 2 号楼 29 楼

网址：www.rtcapital.cn

客服电话：0755-23675188

深圳市融通资本财富管理有限公司

2016 年 3 月