

通乾证券投资基金

[2013] 第四季度报告

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
报告送出日期:2014年1月21日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中的财务数据不存在虚假记载、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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 融通乾封闭

交易代码 500038

基金运作方式 契约型封闭式

基金合同生效日 2001年8月29日

报告期末基金份额总额 2,000,000,000.00份

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金总资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业		3,159,417.00	0.14
B 采矿业		84,422,345.00	3.73
C 制造业		1,300,560,197.76	57.46
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业		33,888,000.00	1.50
E 建筑业		-	-
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		168,548,828.66	7.45
J 金融业		-	-
K 房地产业		-	-
L 租赁和商务服务业		36,250,000.00	1.60
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		43,314,300.00	1.91
S 综合		-	-
合计		1,670,143,088.42	73.79

§ 3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002664	信质电机	2,808,151	113,702,033.99	5.02
2	000895	双汇发展	1,960,070	92,280,095.60	4.08
3	000651	精工钢构	2,600,225	84,923,348.50	3.75
4	300157	恒泰艾普	3,600,100	84,422,345.00	3.73
5	600600	青啤股份	1,700,000	83,215,000.00	3.68
6	600527	江南高纤	11,500,841	80,275,870.18	3.55
7	002475	立讯精密	2,300,516	76,883,244.72	3.40
8	000661	长春高新	700,240	76,116,088.00	3.36
9	300145	南洋万邦	1,962,189	73,876,415.85	3.26
10	600570	恒生电子	3,350,175	69,884,650.50	3.09

§ 4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	492,105,000.00	21.74
4	企业债券	492,105,000.00	21.74
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债	16,113,240.00	0.71
8	其他	-	-
9	合计	508,218,240.00	22.45

§ 5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	060201	06国债1	2,000,000	188,960,000.00	8.35
2	110234	11国债34	1,000,000	99,390,000.00	4.39
3	100236	10国债36	800,000	79,064,000.00	3.49
4	130238	13国债38	500,000	47,500,000.00	2.10
5	130218	13国开18	300,000	29,811,000.00	1.32

§ 6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	060201	06国债1	2,000,000	188,960,000.00	8.35
2	110234	11国债34	1,000,000	99,390,000.00	4.39
3	100236	10国债36	800,000	79,064,000.00	3.49
4	130238	13国债38	500,000	47,500,000.00	2.10
5	130218	13国开18	300,000	29,811,000.00	1.32

§ 7 其他资产

5.6 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本期未持有处于转股期的可转换债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本期未持有权证。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名股指期货投资情况说明

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名国债期货投资情况说明

5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名股票期权投资情况说明

5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资情况说明

5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名资产支持证券投资组合

本基金本期未持有资产支持证券。

5.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名黄金等贵金属投资组合

本基金本期未持有黄金等贵金属。

5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名保险理财产品投资组合

本基金本期未持有保险理财产品。

5.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名股指期货投资组合

本基金本期未持有股指期货。

5.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名国债期货投资组合

本基金本期未持有国债期货。

5.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名股票期权投资组合

本基金本期未持有股票期权。

5.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资组合

本基金本期未持有权证。

5.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名资产支持证券投资组合

本基金本期未持有资产支持证券。

5.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名黄金等贵金属投资组合

本基金本期未持有黄金等贵金属。

5.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名保险理财产品投资组合

本基金本期未持有保险理财产品。

5.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名股指期货投资组合

本基金本期未持有股指期货。

5.23 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名国债期货投资组合

本基金本期未持有国债期货。

5.24 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名股票期权投资组合

本基金本期未持有股票期权。

5.25 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资组合

本基金本期未持有权证。

5.26 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名资产支持证券投资组合

本基金本期未持有资产支持证券。

5.27 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名黄金等贵金属投资组合

本基金本期未持有黄金等贵金属。

5.28 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名保险理财产品投资组合

本基金本期未持有保险理财产品。

5.29 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名股指期货投资组合

本基金本期未持有股指期货。

5.30 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名国债期货投资组合

本基金本期未持有国债期货。

5.31 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名股票期权投资组合

本基金本期未持有股票期权。

5.32 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资组合