融通丰利四分法证券投资基金

【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:中国工商银行股份有限公司
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责任。

基金托管人中国工商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,投资者在作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

2.1 基金基本情况

基金简称	融通丰利四分法证券投资基金
交易代码	161620
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年2月5日
报告期末基金份额总额	450,222,493.63份
投资目标	通过全球化的资产配置和组合管理,有效地分散投资风险;在降低组合波动性的同时,实现基金资产的长期增值;通过投资较高分红回报的资产力求实现稳定的分红。
投资策略	本基金通过全球化的均衡资产配置和组合管理,投资于获取较高分红回报的资产,带来长期稳定的分红和资产增值,降低单一区域和单一品种的投资风险。 本基金主要投资于具有良好流动性的四大类高息资产,包括美国高息债券(US High-yield Bond)、能源类的业主有限合伙制企业(MLPS)、亚太房地产投资信托基金(REITs)及亚太高息股票。
业绩比较基准	巴克莱美国高收益流通总收益指数(Barclays Capital US Corporate High-Yield Very Liquid Total Return Index)×30%+ Alerian MLP 价格指数(Alerian MLP Price Index)×20%+ MSCI亚太(除日本)高息股票价格指数(MSCI AC Asia Pacific ex Japan High Dividend Yield Price Index)×25%+ MSCI亚太REIT价格指数(MSCI AC Asia Pacific IMI REIT Price Index)×20%+人民币活期存款收益率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为基金中基金,属于中等风险中等预期收益的基金品种,其预期收益和风险高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。
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

2.2 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	Nikko Asset Management Co., Ltd.	Brown Brothers Harriman & Co.
	中文	日兴资产管理有限公司	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		107-6242 日本东京都港区赤坂九丁目七番一号	140 Broadway New York, NY 10005
办公地址		107-6242 日本东京都港区赤坂九丁目七番一号	140 Broadway New York, NY 10005
邮政编码		107-6242	NY 10005

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	-3,428,857.87
2.本期利润	13,598,695.69
3.加权平均基金份额本期利润	0.0267
4.期末基金资产净值	437,001,396.25
5.期末基金份额净值	0.971

注:(1)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损益。

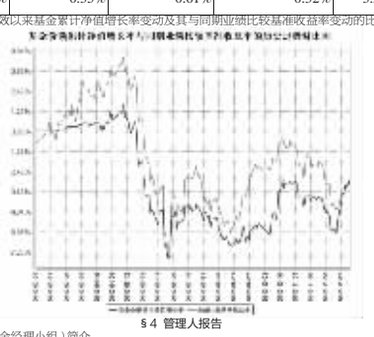
(2)本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	2.97%	0.35%	-0.61%	0.32%	3.58%	0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡允罗	本基金的基金经理	2013年2月5日	-	8	8年证券从业经验,具有证券从业资格。加拿大麦基尔大学经济及金融管理学士。历任日亚证券有限公司(香港)证券研究部副总裁,三井住友资产管理有限公司(香港)大中华区投资研究部投资分析员,摩根大通银行(日本东京总行)债券坐盘交易部分析员,富达基金有限公司(香港及东京分行)财务部财务分析员。2011年至今任融通基金管理有限公司国际业务部分析师。

注:任职日期指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工作的时间为计算标准。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
梁伟雄	投资组合经理	8	Liang Weixiong先生,国籍新加坡,CFA,工商管理学士,8年证券从业经验。历任United Overseas Bank (UOB)衍生工具交易员,Standard Chartered Bank投资策略师,Nikko Asset Management股票投资研究分析师;2012年3月至今,担任Nikko Asset Management ASEAN-Focused Equity Fund的基金经理、在管理国际投资组合方面均有丰富的投资经验。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、《融通丰利四分法基金基金合同》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。基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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,并制定了相应的制度和流程,在授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。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。

4.4.2 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。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

环球金融市场在2013年第4季度持续反复波动。风险资产如股票,债券和商品仍然受到不确定的货币及财政政策影响而导致其波动性有所增加。但总的来说,投资表现按季度比较都有改善。

在季度初,市场忧虑美国政府关门以及债务上限等问题会导致美国发生债务违约,导致全球各个金融市场出现震荡局面。但随着美国国会再竞跛煲算和提高债务上限等问题达成短暂共识避免了违约风险,投资者风险偏好增加刺激风险资产表现大幅上扬。

在季度中,市场再次担心美联储会在2013年最后一次议息会议上宣布退出QE,美国长期国债利率迅速从2.48%上升至2.84%影响高收益资产的投资表现。然而,下任美联储主席耶伦向市场表达了美联储会继续维持高度宽松的货币政策来支持经济稳定复苏。言论对美股起了刺激作用导致各个美股主要指数再创新高。

在季度末,美联储正式宣布启动退市程序并自2014年1月起缩减买债规模100亿美元至750亿美元。由于市场早已预期退市消息,因此会议结果没有再次造成金融市场大幅下跌压力。相反而言,市场反应十分正面主要是因为委员会重申其预期,对美国经济前景抱有信心,并预计未来一段长时间都会维持超低利率政策来支持经济增长。年终前美国各个主要指数的升幅都不断放大并以高位收盘。

在报告期内,我们采取了谨慎的投资策略并透过灵活仓位配置严格控制风险。这些紧急措施都有助我们降低组合的总风险。我们组合的表现和稳定性是要透过比较长的时间来证明并且发挥战略作用的。我们依然对各类资产的长期表现有信心。

4.5.2 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2.97%,同期业绩比较基准收益率为-0.61%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	57,800,909.31	13.01
	其中:普通股	34,752,625.99	7.82
	优先股	-	-
	存托凭证	-	-
	房地产信托凭证	23,048,283.32	5.19
2	基金投资	327,203,152.02	73.64
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	24,186,041.87	5.44
8	其他资产	35,134,769.89	7.91
9	合计	444,324,873.09	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
澳大利亚	22,353,772.31	5.12
香港	17,676,172.25	4.04
日本	11,820,928.72	2.70
台湾	5,950,036.03	1.36
合计	57,800,909.31	13.23

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
金融	49,266,605.36	11.27
科技	4,790,669.80	1.10
能源	2,829,641.77	0.65
工业	913,992.38	0.21
合计	57,800,909.31	13.23

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.4 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	WESTPAC BANKING CORP	西太平洋银行公司	WBC AT	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	63,000	11,126,417.69	2.55
2	CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	中国信达资产管理股份有限公司	1359 HK	港交所	香港	1,435,000	5,460,681.84	1.25
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	台积电	2330 TT	台湾证券交易所	台湾	222,000	4,790,669.80	1.10
4	CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	招商银行	3968 HK	港交所	香港	144,500	1,876,841.08	0.43
5	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	建设银行	939 HK	港交所	香港	398,000	1,830,579.31	0.42
6	BANK OF CHINA LTD	中国银行	3988 HK	港交所	香港	600,000	1,684,104.66	0.39
7	WESTFIELD RETAIL TRUST	西田零售信托公司	WRT AT	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	100,000	1,619,923.16	0.37
8	BOC HONGKONG HOLDINGS LTD	中银香港	2388 HK	港交所	香港	81,000	1,582,563.06	0.36
9	INVESTA OFFICE FUND	写字楼基金	IOF AT	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	90,446	1,544,086.65	0.35
10	AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	农业银行	1288 HK	港交所	香港	500,000	1,497,768.15	0.34

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

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十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	JPMORGAN ALERIAN MLP INDEX	ETN	开放式	JP Morgan Chase & Co	48,323,114.87	11.06
2	SPDR BARCLAYS SHORT-TERM HIG	ETF	开放式	State Street Bank and Trust Company	43,462,727.15	9.95
3	CREDIT SUISSE CUSHING 30 MLP	ETN	开放式	Credit Suisse	22,042,067.70	5.04
4	SPDR EURO STOXX 50 ETF	ETF	开放式	State Street Bank and Trust Company	19,203,292.53	4.39
5	ISHARES DJ INTL SELECT DIV	ETF	开放式	BlackRock Fund Advisors	18,524,820.96	4.24
6	WISDOMTREE JAPAN HEDGED EQ	ETF	开放式	WisdomTree Asset Management Inc	18,261,050.29	4.18
7	PROSHARES ULTRA QQQ	ETF	开放式	ProShares Trust	17,974,636.70	4.11
8	VANGUARD FTSE EUROPE ETF	ETF	开放式	The Vanguard Group	16,885,242.61	3.86
9	ISHARES MSCI AUSTRALIA ETF	ETF	开放式	BlackRock Fund Advisors	16,343,959.83	3.74
10	PROSHARES ULTRASHORT 20+Y TR	ETF	开放式	ProShares Trust	14,969,108.88	3.43

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.10.2

本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	34,493,238.91
3	应收股利	639,229.39
4	应收利息	814.64
5	应收申购款	1,486.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,134,769.89

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资部分前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	547,544,983.62
报告期期间基金总申购份额	26,065.32
减:报告期期间基金总赎回份额	97,348,555.31
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	450,222,493.63

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准融通丰利四分法证券投资基金设立的文件

(二)《融通丰利四分法证券投资基金基金合同》

(三)《融通丰利四分法证券投资基金托管协议》

(四)《融通丰利四分法证券投资基金招募说明书》及其更新

(五)《融通基金管理有限公司开放式基金业务管理规则》

(六)融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照

(七)报告期内在指定报刊上披露的各项公告

8.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件,或登陆本基金管理人网站http://www.rtfund.com查询。

融通基金管理有限公司
二零一四年一月二十一日

融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)

【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:中国工商银行股份有限公司

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责任。

基金托管人中国工商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,投资者在作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2013年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通巨潮100指数(LOF)
交易代码	161607
前端交易代码	161607
后端交易代码	161657
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2005年5月12日
报告期末基金份额总额	2,382,388,063.65份
投资目标	本基金为增强型指数基金。在控制股票投资组合相对巨潮100目标指数跟踪误差的基础上,力求获得超越巨潮100目标指数的投资收益,追求长期的资本增值。本基金谋求分享中国经济的持续、稳定增长和中国证券市场发展的成果,实现基金财产的长期增长,为投资者带来稳定的回报。
投资策略	本基金为增强型指数基金,在控制股票投资组合相对目标指数偏离风险的基础上,力争获得超越目标指数的投资收益。基金以指数化分散投资为主要投资策略,在此基础上进行适度的主动调整,在数量化投资技术与基本面深入研究的结合中谋求基金投资组合在偏离风险及超额收益间的最佳匹配。为控制基金偏离目标指数的风险,本基金力求将基金份额净值增长率与目标指数增长率间的日跟踪误差控制0.5%。
业绩比较基准	巨潮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
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	-111,836,609.00
2.本期利润	-62,796,886.42
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0259
4.期末基金资产净值	1,708,956,753.88
5.期末基金份额净值	0.717

注:(1)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损益。

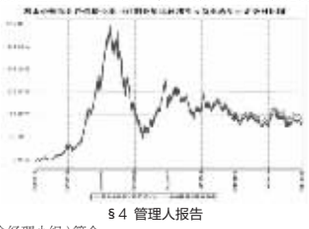
(2)本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-3.63%	1.09%	-3.40%	1.09%	-0.23%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王建强	本基金的基金经理、融通深证100指数基金基金经理、融通深证成份指数基金基金经理、融通创业板指数基金基金经理	2009年5月15日	-	10	本科学历,具有证券从业资格。2001年至2004年就职于上海市万得信息技术股份有限公司;2004年至今就职于融通基金管理有限公司,历任金融工程研究员、基金经理助理职务。

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、《融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)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。基金投资组合符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.31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,并制定了相应的制度和流程,在授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。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。

4.3.2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 报告期内基金投资策略和运作分析

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之中。本基金运用指数化投资方式,通过控制股票投资权重与巨潮100指数成份股自然权重的偏离,减少基金相对巨潮100指数基金基准的跟踪误差,力求最终实现对巨潮100指数基金基准的有效跟踪。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2013年第四季度证券市场整体小幅度回调,行业指数分化明显,大盘指数中沪深300指数下跌3.28%,成长股龙头的创业板指数下跌4.64%。从中信行业类指数的表现来看:家电行业涨幅18.13%,农林牧渔涨幅8.52%、国防军工行业涨幅8.13%、机械行业涨幅6.35%;而银行、房地产、商业贸易、通信、有色、煤炭、传媒等行业指数跌幅均超过5%,落后于沪深300指数。巨潮100指数在2013年第四季度下跌3.60%,同期巨潮100指数基金净值下跌3.63%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,606,470,142.15	93.74
	其中:股票	1,606,470,142.15	93.74
2	固定收益投资	79,496,000.00	4.64
	其中:债券	79,496,000.00	4.64
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	25,583,126.32	1.49
6	其他资产	2,172,885.85	0.13
7	合计	1,713,722,154.32	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	99,266,961.71	5.81
C	制造业	482,162,944.08	28.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	36,739,340.22	2.15
E	建筑业	42,109,740.13	2.46
F	批发和零售业	29,173,306.31	1.71
G	交通运输、仓储和邮政业	31,743,707.89	1.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	44,595,419.74	2.61
J	金融业	741,568,744.07	43.39
K	房地产业	71,098,797.96	4.16
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	-	-
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	14,678,843.18	0.86
S	综合	13,332,336.86	0.78
	合计	1,606,470,142.15	94.00

5.2.2报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

5.3 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

5.3.1报告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

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	601318	中国平安	2,389,527	99,714,961.71	5.83
2	600016	民生银行	10,872,861	83,938,486.92	4.91
3	600036	招商银行	7,610,641	82,879,880.49	4.85
4	601166	兴业银行	5,645,485	57,245,217.90	3.35
5	600000	浦发银行	5,484,374	51,717,646.82	3.03
6	600030	中信证券	3,633,919	46,332,467.25	2.71
7	600837	海通证券	4,013,002	45,427,182.64	2.66
8	000651	格力电器	1,133,949	37,034,774.34	2.17
9	000002	万 科A	4,243,399	34,074,493.97	1.99
10	601288	农业银行	13,678,916	33,923,711.68	1.99

5.3.2报告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五名股票投资明细

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

5.4 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	79,496,000.00	4.65
	其中:政策性金融债	79,496,000.00	4.65
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	79,496,000.00	4.65

5.5 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	130218	13国开18	800,000	79,496,000.00	4.65

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.10.2 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	290,057.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,837,800.03
5	应收申购款	45,027.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,172,885.85

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,467,082,043.37
报告期期间基金总申购份额	14,996,322.45
减:报告期期间基金总赎回份额	99,690,302.17
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	2,382,388,063.65

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)设立的文件

(二)《融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)基金合同》

(三)《融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)托管协议》

(四)《融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)招募说明书》及其更新

(五)融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照

(六)报告期内在指定报刊上披露的各项公告

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处、深圳证券交易所

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件,或登陆本基金管理人网站http://www.rtfund.com查询。

融通基金管理有限公司
二〇一四年一月二十一日

融通领先成长股票型证券投资基金(LOF)

【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	融通领先成长股票(LOF)
交易代码	161610
前端交易代码	161610
后端交易代码	161660
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2007年4月30日
报告期末基金份额总额	3,100,984,958.42份
投资目标	本基金主要投资于业绩能持续高速增长的上市公司,通过积极主动的分散化投资策略,在严格控制风险的前提下实现基金资产的持续增长,为基金持有人获取长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金认为股价上升的主要推动力来自于企业盈利的不断增长。在中国经济长期高速增长的大背景下,许多企业在一定时期表现出较高的成长性,但只有符合产业结构发展趋势,同时在技术创新、经营模式、品牌、渠道、成本等方面具有领先优势的企业,才能保持业绩持续高速成长,而这些企业正是本基金重点投资的目标和获得长期超额回报的基础。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中信标普全债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金是较高预期收益较高预期风险的产品,其预期收益与风险高于混合基金、债券基金与货币市场基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	16,599,250.42
2.本期利润	-163,446,977.38
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0519
4.期末基金资产净值	2,270,104,444.78
5.期末基金份额净值	0.732

注:1、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。

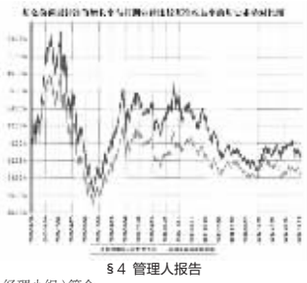
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-6.51%	1.24%	-2.81%	0.90%	-3.70%	0.34%

3.2.2 自基金转型以来基金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



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
余志勇	本基金的基金经理	2012年8月10日	-	14	金融学硕士,具有证券从业资格。先后任职于湖北省农业厅、闽发证券,2004年加入招商证券股份有限公司研究发展中心,从事房地产行业研究工作。2007年加入融通基金管理有限公司,曾任研究部行业研究员、行业组长。

注:任职日期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、《融通领先成长股票型证券投资基金(LOF)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,基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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,并制定了相应的制度和流程,在授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易的原则和