浙商聚盈信用债债券型证券投资基金

【2013】第四季度报告

基金管理人:浙商基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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

基金简称	浙商聚盈信用债债券	
基金主代码	686868	
交易代码	686868	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年9月18日	
报告期末基金份额总额	24,171,990.29份	
投资目标	在有效控制风险与保持资产流动性的前提下,通过严格的信用分析和对信用利差变动趋势的判断,追求基金资产长期、持续、稳定增值,力争获得超越业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金采用自上而下与自下而上相结合的投资策略,在科学分析与有效管理信用风险的基础上,实现风险与收益的最佳配比。一方面,本基金通过深入分析影响证券市场各个因素的运行趋势及其对证券市场的作用机制,综合分析评判证券市场中债券、股票等各类资产风险收益特征的相对变化,在投资组合比例范围内适时调整债券、股票等资产的配置比例;另一方面,本基金通过久期策略、收益率曲线策略、信用利差曲线策略、信用债个券分析策略、息差套利策略和可转换债券投资策略等固定收益投资策略,以增加投资组合的收益。	
业绩比较基准	中债综合指数收益率(全价)	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与预期收益低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。	
基金管理人	浙商基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	浙商聚盈信用债债券A	浙商聚盈信用债债券C
下属两级基金的交易代码	686868	686869
报告期末下属两级基金的份额总额	7,052,352.36	17,119,637.93

§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

基金简称	报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)	
	浙商聚盈信用债债券A	浙商聚盈信用债债券C
1.本期已实现收益	-140,838.14	-433,414.14
2.本期利润	-313,512.63	-1,239,471.08
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0352	-0.0366
4.期末基金资产净值	7,109,872.33	17,158,123.23
5.期末基金份额净值	1.008	1.002

注: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。

3.2 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

浙商聚盈信用债债券A

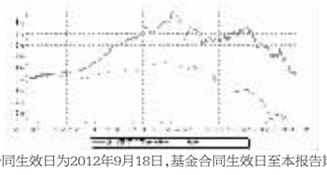
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.45%	0.22%	-2.68%	0.10%	-0.77%	0.12%

浙商聚盈信用债债券C

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	-3.56%	0.21%	-2.68%	0.10%	-0.88%	0.11%

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

本基金A类累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

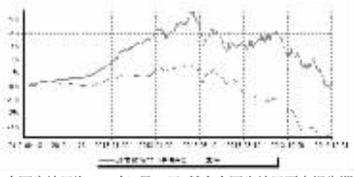


注:1、本基金基金合同生效日为2012年9月18日,基金合同生效日至本报告期期末,本基金生效时间已满一年。

2、本基金建仓期为6个月,从2012年9月18日至2013年3月17日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3、本基金业绩比较基准为:中债综合指数收益率(全价)。

本基金C类累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:1、本基金基金合同生效日为2012年9月18日,基金合同生效日至本报告期期末,本基金生效时间已满一年。

2、本基金建仓期为6个月,从2012年9月18日至2013年3月17日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3、本基金业绩比较基准为:中债综合指数收益率(全价)。

§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		
洪慧梅	本基金的基金经理	2012年9月18日	-	7	洪慧梅女士,浙商基金管理有限公司固定收益研究主管,同济大学经济与管理学院金融学硕士。历任平安资产管理有限责任公司集中交易部债券交易员,汇丰人寿保险有限责任公司投资管理部交易主任。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,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,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为,本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了规范公平交易行为,保护投资者合法权益,根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规规定,本公司制定了相应的公平交易制度。在投资决策层面,本公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,对不同类别的投资组合分别管理、独立决策;在交易层面,实行集中交易制度,建立了公平的交易分配制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会,严禁在不同投资组合之间进行利益输送;在监控和评估层面,本公司金融工程小组将每日审查当天的投资交易,对不同投资组合在交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差进行监控,同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内,本基金未发生违反公平交易制度的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面,未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况,亦未受到监管机构的相关调查。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金在四季度主要投资企业债和可转债,由于担忧信用风险的暴露,四季度逐步减少企业债的持仓比例,同时适当增加国债和可转债的配置比例。今年下半年以来,持续紧张的资金面使得债券市场下跌幅度明显,一二级市场债券收益率高企,这也增加了一些行业出现信用风险事件的概率,因此目前对企业债仍旧保持相对谨慎的态度。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2013年12月31日为止,本基金A类份额净值为1.008元,本报告期内份额净值增长率为-3.45%,同期业绩比较基准收益率为-2.68%;本基金C类份额净值为1.002元,本报告期内份额净值增长率为-3.56%,同期业绩比较基准收益率为-2.68%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年货币市场利率预计仍将维持较高水平,但是随着利率市场化进程逐渐进入尾声,以及市场对央行相对从紧的货币政策形成共识,资金价格的波动幅度可能会有所下降,因此对于基金组合来说仍要严格控制债券的投资仓位。另外高企的融资成本可能会使部分行业和一些资质较差的地方政府融资平台出现不同程度的违约现象,因此要严格甄别个券。改革仍是2014年全年的主基调,因此经济基本面将会保持相对平稳,不会对债券构成特别利空。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	20,296,825.00	79.09
	其中:债券	20,296,825.00	79.09
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	1,000,000.00	3.90
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,082,544.13	8.11
7	其他各项资产	2,284,843.70	8.90
8	合计	25,664,212.83	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	13,320,925.00	54.89
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	6,975,900.00	28.75
8	其他	-	-
9	合计	20,296,825.00	83.64

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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	124104	12巢城投	33,500	3,237,775.00	13.34
2	122680	12昆建债	20,000	2,010,000.00	8.28
3	124010	12鸡国资	20,000	1,958,400.00	8.07
4	122209	12中油01	18,930	1,832,424.00	7.55
5	126011	08石化债	18,000	1,789,380.00	7.37

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

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

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 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体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、处罚的情况。

5.10.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	10,793.67
2	应收证券清算款	2,076,425.12
3	应收股利	-
4	应收利息	197,524.91
5	应收申购款	100.00
6	其他应收款	-
8	待摊费用	-
9	其他	-
10	合计	2,284,843.70

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110018	国电转债	1,340,950.00	5.53
2	125887	中鼎转债	1,159,160.00	4.78
3	125089	深机转债	753,816.00	3.11
4	110022	同仁转债	499,760.00	2.06
5	110023	民生转债	482,650.00	1.99
6	113001	中行转债	481,650.00	1.98
7	113003	重工转债	466,120.00	1.92
8	110017	中海转债	455,850.00	1.88

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	浙商聚盈信用债债券A	浙商聚盈信用债债券C
本报告期期初基金份额总额	11,356,606.23	52,669,314.53
本报告期基金总申购份额	168,237.28	144,995.00
减:本报告期基金总赎回份额	4,472,491.15	35,694,671.60
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	7,052,352.36	17,119,637.93

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准浙商聚盈信用债债券型证券投资基金设立的相关文件;

2、《浙商聚盈信用债债券型证券投资基金招募说明书》;

3、《浙商聚盈信用债债券型证券投资基金基金合同》;

4、《浙商聚盈信用债债券型证券投资基金托管协议》;

5、基金管理人业务资格批件和营业执照;

6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告;

7、中国证监会要求的其他文件。

7.2 存放地点

杭州市西湖区教工路18号世贸丽晶城欧美中心1号楼D区6层606室

7.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅,或登录基金管理人网站www.zsfund.com查阅,还可拨打基金管理人客户服务中心电话:400-067-9908/021-60359000查询相关信息。

浙商基金管理有限公司
二〇一四年一月二十一日

融通动力先锋股票型证券投资基金

【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2013年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通动力先锋股票
交易代码	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
报告期末基金份额总额	1,912,960,238.06份
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硕果,以获取丰厚的资产增值机会。
业绩比较基准	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
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	119,886,766.84
2.本期利润	-226,083,419.57
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1133
4.期末基金资产净值	2,183,717,533.17
5.期末基金份额净值	1.142

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	-9.22%	1.62%	-3.10%	0.90%	-6.12%	0.72%

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

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全债指数收益率×20%",2013年7月1日起使用新基准即"沪深300指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%"。

§4 管理人报告

4.1 基金经理简介

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		
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、华睿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

前三季度创业板前期涨幅过大,特别是文化传媒和信息服务板块涨幅和估值与主板差距超过历史高位,进入第四季度没有事件驱动和超预期因素等;创业板开始大幅调整。11月十八届三中全会召开,确立了中国未来中期改革路线图,大大改善了市场投资者预期,股票市场主题投资热点此起彼伏。家电和汽车两大消费数据超预期,四季度演绎出估值低稳定增长的蓝筹股逆袭。进入12月后大盘股和小盘股收益差出现收敛,板块之间相对收益不大。本基金减持部分文化传媒,信息服务类股票,增持了铁路设备,环保,医疗服务和移动互联类股票。

4.5 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-9.22%,同期业绩比较基准收益率为-3.10%。

§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	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	其他资产	3,291,318.76	0.15
7	合计	2,265,725,847.67	100.00

5.2 报告期末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	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

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

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	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

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	99,300,000.00	4.55
	其中:政策性金融债	99,300,000.00	4.55
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,375,109.40	0.11
8	其他	-	-
9	合计	101,675,109.40	4.66

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	130243	13国开43	1,000,000	99,300,000.00	4.55
2	110022	同仁转债	19,010	2,375,109.40	0.11

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

截止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本期是否出现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、处罚的情形:

1、长春高新于2013年5月2日公告,其于2013年4月8日收到的吉林证监局下发的吉证监决【2013】4号《关于对长春高新技术产业(集团)股份有限公司采取责令改正措施的决定》并于2013年4月12日对该《责令改正决定书》的内容进行了公告,整改结果为由公司实际控制人长春高新技术产业发展总公司下属企业——长春高新光电发展有限公司代偿关联方长春医药(集团)有限责任公司的上述欠款,金额合计2,974.62万元。

公司已针对上述欠款计提坏账准备金共计2,974.62万元,经与本公司聘请的会计师事务所确认,本次收回欠款将在2013年第二季度冲抵坏账准备并增加本期收益2,974.62万元。对公司生产经营没有重大影响。

2、宏大爆破股份有限公司于2013年1月25日公告:近日,韶关市安全生产监督管理局对公司下属子公司---广东明华机械有限公司韶关分公司、罗定分公司分别出具了《行政处罚决定书》,((韶)安监管罚【2012】14号,(韶)安监管罚【2012】15号),《行政处罚决定书》相关内容如下:

广东明华机械有限公司韶关分公司对车辆管理混乱,转让租赁手续不清,对京港澳高速公路韶关曲江路段宝林山隧道"8.22"事故发生负有责任,依据有关规定,决定给予处以人民币10万元罚款的行政处罚。

广东明华机械有限公司罗定分公司在运输危险货物时没有遵守有关法律法规对危险货物运输的有关规定,使用未取得危险货物运输许可证的车辆运输危险货物,对京港澳高速公路韶关曲江路段宝林山隧道"8.22"事故发生负有责任,依据有关规定,决定给予处以人民币10万元罚款的行政处罚。

该事件对上市公司不构成重大影响,目前,广东明华机械有限公司的危险品运输工作正常开展。

3、报告期内,基金投资的前十名证券中其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查的,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	2,250,541.10
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	914,555.42
5	应收申购款	126,222.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,291,318.76

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110022	同仁转债	2,375,109.40	0.11

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	1,927,864,994.59
报告期期间基金总申购份额	184,716,865.69
减:报告期期间基金总赎回份额	199,621,622.22
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,912,960,238.06

§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动力先锋股票型证券投资基金设立的文件

(二)《融通动力先锋股票型证券投资基金基金合同》

(三)《融通动力先锋股票型证券投资基金托管协议》

(四)《融通动力先锋股票型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
二〇一四年一月二十一日

融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金

【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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	融通标普中国可转债指数增强	
交易代码	161624	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年3月26日	
报告期末基金份额总额	171,683,898.28份	
投资目标	本基金为增强型指数基金,对指数投资部分,采用最优复制法的投资策略,按照成份券在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份券及其权重的变化进行相应调整。本基金对主动投资部分,采取积极配置策略,利用可转债兼具债券和股票的特性,力争实现在控制基金资产下跌风险和保证投资组合流动性的基础上,为投资者获得超越业绩比较基准的稳健收益。	
投资策略	本基金为增强型指数基金,对指数投资部分,采用最优复制法的投资策略,主要以标的指数的成份券及其备选成份券构成为基础,综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合,并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及交易所可转债交易特性等情况,对投资组合进行优化调整,以保证对标的指数的有效跟踪。对主动投资部分,采取积极配置策略,力争在有效跟踪标的指数的基础上,获取超越基准的业绩表现。如果未来可转债市场出现流动性不足、券种数量下降或其它不可预见的异常情况,导致本基金无法有效对指数进行跟踪和合理配置,本基金可选择在主动投资部分适当增加对其它金融工具的投资比例,以作为对可转债投资的临时性替代。	
业绩比较基准	标普中国可转债价格指数x95%+银行活期存款利率(税后)x5%	
风险收益特征	本基金是债券型指数基金,长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金,属于较低风险、较低收益的品种。	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	融通标普中国可转债指数增强A	融通标普中国可转债指数增强C
下属两级基金的交易代码	161624	161625
报告期末下属两级基金的份额总额	101,935,056.59份	69,748,841.69份

§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)	
	融通标普中国可转债指数增强A	融通标普中国可转债指数增强C
1.本期已实现收益	-3,470,957.74	-2,637,321.98
2.本期利润	-6,259,608.86	-5,046,482.22
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0551	-0.0555
4.期末基金资产净值	94,398,086.32	64,379,569.66
5.期末基金份额净值	0.926	0.923

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

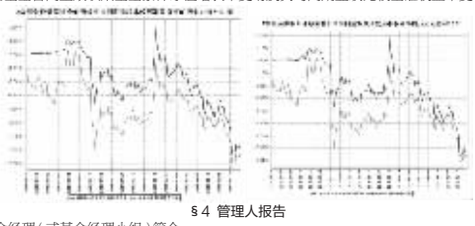
融通标普中国可转债指数增强A

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	-5.70%	0.46%	-4.27%	0.42%	-1.43%	0.04%

融通标普中国可转债指数增强C

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	-5.72%	0.47%	-4.27%	0.42%	-1.45%	0.05%

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		
张李陵	本基金的基金经理、融通债券基金经理、融通七天理财债券基金经理	2013年3月26日	-	8	清华大学经济学硕士、理学学士,具有证券从业资格。2006年7月至2012年7月在招商银行总行工作,主要从事债券投资和交易。2012年7月加入融通基金管理有限公司。
王超	本基金的基金经理、融通债券的基金经理	2013年12月27日	-	7	金融工程硕士,经济学、数学双学士,7年证券从业经验,具有证券从业资格。2007年7月至2012年8月在深圳发展银行(现更名为平安银行)