

6	报告期内本基金前十名重仓基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资策略 本基金本报告期末未持有资产支持证券。		17,000,000	70,289,000.00	2.00
7	报告期内本基金前十名重仓基金资产净值比例大小排序的前五名金融债投资策略 本基金本报告期末未持有金融债。				
8	报告期内本基金前十名重仓基金资产净值比例大小排序的五只权证投资策略 本基金本报告期末未有权证投资。				
9	报告期内本基金投资的股指期货交易情况说明 5.9.1 报告期内本基金无股指期货持仓和损益明细 本基金本报告期末未有股指期货投资。 5.9.2 本基金股指期货投资的持仓政策 本基金本报告期末无股指期货持仓。 5.10 报告期内本基金投资的国债期货交易情况说明 5.10.1 本期国债期货投资情况 本基金本报告期末无国债期货持仓。 5.10.2 报告期内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有国债期货投资。 5.10.3 本期国债期货投资的持仓政策 本基金本报告期末无国债期货持仓。 5.11 投资组合报告备注 5.11.1 本基金收益分配：本基金的收益分配方案经报告期内有效监督部门立案审查，或在报告编制日前一年内经过公开披露、执行。 5.11.2 本基金持有的前十名股票市值超出本基金合同规定的备选股票票。 5.11.3其他需作说明：				
序号	名称	金额(元)			
1	存出保证金		1,544,184.61		
2	应收证券清算款		97,096,082.04		
3	应收股利				
4	应收利息		50,710,701.62		
5	应收申购款		88,222.11		
	其他金融资产				

7	待摊费用			—
8	其他			—
9	合计			149,439,190.38

5.11.4 报告期末持有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	110023	民生转债	27,840,000.00	0.33
2	113005	平安转债	4,642,397.20	0.05

5.11.5 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

报告期间期初基金份额总额	12,377,965,824.64
报告期间期间基金总申购份额	11,028,703.73
减:报告期间期间基金总赎回份额	403,013,285.15
报告期间期末基金份额总额	11,985,981,243.22

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 查文件目录

8.1 备查文件目录

(一) 中国证监会核准融通新嘉证券证券投资基金设立的文件

(二) 《融通新嘉证券证券投资基金合同》

(三) 《融通新嘉证券证券投资基金托管协议》

(四) 《融通新嘉证券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、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>。

融通基金管理有限公司  
二〇一四年七月二十九日

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金股指期货投资期的投资策略

截止本报告期末投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货持仓。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货持仓。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,274,950.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,160,209.46
5	应收申购款	160,797.35
6	其他应收款	-

7	其他	—
9	合计	2,595,957.11

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 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	3,105,444,358.83
报告期期间基金总申购份额	16,918,383.97
减：报告期期间基金总赎回份额	182,552,310.74
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	—
报告期末基金份额总额	2,939,810,432.06

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 备查文件目录

（一）中国证监会批准融通行业景气证券投资基金设立的文件

（二）《融通行业景气证券投资基金合同》

（三）《融通行业景气证券投资基金托管协议》

（四）《融通行业景气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、基金托管人处。

8.3 查阅方式  
投资者可在营业时间内免费查阅，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。

本基金报告期末未持有待偿票据。	
6.10 本基金报告期末投资股指期货政策	
本基金本报告期末未投资股指期货。	
6.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	
6.10.1 本期国债期货投资政策	
本基金本报告期末未投资国债期货。	
6.10.2 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投资国债期货。	
6.10.3 本期国债期货投资评价	
本基金本报告期末未投资国债期货。	
6.11 投资衍生品情况说明	
6.11.1 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。	
6.11.2 本基金投资的前十名证券未超出本基金合同约定的备选股票库。	
6.11.3 其他资产构成	

  

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,617,659.66
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	108,497.40
5	应收申购款	9,771,949.49
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	11,498,106.55

  

6.11.4 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。

6.11.5 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	2,563,091,772.78
报告期期间基金总申购份额	101,656,617.41
减:报告期期间基金总赎回份额	456,311,019.16
报告期期末基金份额总额	2,908,437,371.03

#### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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医疗保健行业股票型证券投资基金设立的文件
- (二)《融通医疗保健行业股票型证券投资基金合同》
- (三)《融通医疗保健行业股票型证券投资基金托管协议》
- (四)《融通医疗保健行业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开放式基金业务管理制度》
- (六)《融通基金管理有限公司证券投资基金托管协议和营业执照》
- (七)报告期内在指定报刊上披露的其它公告

##### 8.2 存放地点

基金管理人、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[www.tntfund.com](http://www.tntfund.com)查询。

融通基金管理有限公司

二〇一四年七月二十一日