融通通利系列证券投资基金之融通蓝筹成长证券投资基金

【2014】第二季度报告

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7月21日

§1 重要提示

融通通利系列证券投资基金由融通债券投资基金、融通深证100指数证券投资基金和融通蓝筹成长证券投资基金共同构成。本报告为融通通利系列证券投资基金之子基金融通蓝筹成长证券投资基金(以下简称“本基金”)2014年第2季度报告。

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据《融通通利系列证券投资基金基金合同》规定,于2014年7月15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2014年4月1日起至2014年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通蓝筹成长混合
交易代码	161605
前端交易代码	161605
后端交易代码	161655
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年9月30日
报告期末基金份额总额	1,407,929,299.40份
投资目标	组合投资,资本增值,为持有人获取长期稳定的投资收益。
投资策略	在对市场趋势判断的前提下,重视仓位选择和行业配置,同时更重视基本面分析,强调通过基本面分析挖掘个股。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+中信标普全债指数收益率×25%
风险收益特征	力求获得超过市场平均水平的收益,承担相应的风险。
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(2014年4月1日 - 2014年6月30日)
1.本期已实现收益	-4,634,389.23
2.本期利润	20,554,305.62
3.加权平均基金份额本期利润	0.0144
4.期末基金资产净值	1,412,971,875.26
5.期末基金份额净值	1.004

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	1.52%	0.95%	1.30%	0.66%	0.22%	0.29%

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:本基金业绩比较基准项目分段计算,其中:2009年12月31日(含此日)之前采用“国泰君安指数×75%+银行间债券综合指数×25%”,2010年1月1日起使用新基准即“沪深300指数收益率×75%+中信标普全债指数收益率×25%”。

§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		
严菲	本基金的基金经理、融通行业景气混合基金基金经理	2007年3月2日	-	11	经济学硕士,具有证券从业资格。曾先后就职于日盛嘉富证券国际上海代表处、红塔证券从事证券研究工作。2006年7月加入融通基金管理有限公司任行业研究员。

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 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、《融通通利系列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

2014年2季度人股市场各类指数表现分化,上证指数上涨0.74%,深证成指上涨2.14%,中小板指数上涨4.35%,创业板指数上涨5.79%。板块来看,国防军工、计算机、通信、电子、有色、传媒等行业表现较好。本基金投资策略选择符合经济转型方向、需求端景气快速上升的行业和个股,主要持有高端装备、医疗服务和计算机板块等行业。2季度本基金减持了一些估值偏高的个股,持仓结构维持稳定。

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1.52%,同期业绩比较基准收益率为1.30%。

§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	816,903,355.47	54.10
	其中:股票	816,903,355.47	54.10
2	固定收益投资	400,613,015.00	26.53
	其中:债券	400,613,015.00	26.53
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	160,000,000.00	10.60
	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	111,967,570.77	7.42
7	其他资产	20,430,242.11	1.35
8	合计	1,509,914,183.35	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	35,215,711.44	2.49
B	采矿业	41,757,470.40	2.96
C	制造业	451,715,197.28	31.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	37,669,678.80	2.67
G	交通运输、仓储和邮政业	50,478,460.36	3.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	200,066,837.19	14.16
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	816,903,355.47	57.81

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	300307	慈星股份	5,299,849	56,178,399.40	3.98
2	002565	上海绿新	6,040,946	55,757,931.58	3.95
3	300045	华力创通	2,564,786	50,911,002.10	3.60
4	601006	大秦铁路	7,999,756	50,478,460.36	3.57
5	300164	通源石油	2,561,808	41,757,470.40	2.96
6	600570	恒生电子	1,315,399	38,672,730.60	2.74
7	000516	开元投资	5,599,910	37,631,395.20	2.66
8	002321	华英农业	6,449,764	35,215,711.44	2.49
9	600525	长园集团	3,000,000	33,120,000.00	2.34
10	600587	新华医疗	439,823	32,788,804.65	2.32

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	399,555,000.00	28.28
	其中:政策性金融债	399,555,000.00	28.28
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,058,015.00	0.07
8	其他	-	-
9	合计	400,613,015.00	28.35

5.5 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	130227	13国开27	1,000,000	100,000,000.00	7.08
2	140207	14国开07	900,000	90,324,000.00	6.39
3	100236	10国开36	500,000	50,110,000.00	3.55
4	120229	12国开29	500,000	49,560,000.00	3.51
5	120219	12国开19	300,000	29,916,000.00	2.12

5.6 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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未投资股指期货。

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

本基金本报告期未投资国债期货。

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

本基金本报告期未投资国债期货。

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、本基金持有的通源石油在2013年11月21日公告被陕西省证监局立案调查,并于2013年12月10日公告收到陕西证监局《关于对西安通源石油科技股份有限公司采取责令改正措施的决定》的公告,公告里查明通源石油违反了《证券法》第六十三条、《上市公司信息披露管理办法》(证监会令第40号)第二条的规定,应当在2013年12月25日前,向陕西证监局提交书面报告,详细说明整改落实情况。本基金是在2014年投资通源石油,是在公司信息披露已经整改合规后才进行投资的。

2、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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,151,861.70
2	应收证券清算款	10,789,578.19
3	应收股利	-
4	应收利息	8,275,419.67
5	应收申购款	213,382.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,430,242.11

5.11.4 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	1,058,015.00	0.07

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002565	上海绿新	55,757,931.58	3.95	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,452,062,318.85
报告期期间基金总申购份额	12,112,576.30
减:报告期期间基金总赎回份额	56,245,595.75
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,407,929,299.40

§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

8.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准融通通利系列证券投资基金设立的文件

(二)《融通通利系列证券投资基金基金合同》

(三)《融通通利系列证券投资基金托管协议》

(四)《融通通利系列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www.rtfund.com查询。

融通基金管理有限公司

二〇一四年七月二十一日

融通通利系列证券投资基金之融通深证100指数证券投资基金

【2014】第二季度报告

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7月21日

§1 重要提示

融通通利系列证券投资基金由融通债券投资基金、融通深证100指数证券投资基金和融通蓝筹成长证券投资基金共同构成。本报告为融通通利系列证券投资基金之子基金融通深证100指数证券投资基金(以下简称“本基金”)2014年第2季度报告。

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据《融通通利系列证券投资基金基金合同》规定,于2014年7月15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2014年4月1日起至2014年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通深证100指数
交易代码	161604
前端交易代码	161604
后端交易代码	161654
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年9月30日
报告期末基金份额总额	13,048,790,768.39份
投资目标	运用指数化投资方式,通过控制股票投资组合与深证100指数的跟踪误差,力求实现对深证100指数的有效跟踪,谋求分享中国经济的持续、稳定增长和中国证券市场的发展,实现基金资产的长期增长,为投资者带来稳定回报。
投资策略	以非借券资产90%以上的资金对深证100指数的成份股进行股票指数化投资。股票指数化投资部分不得低于基金资产的50%,采用复制法跟踪深证100指数,对于因流动性等原因导致无法完全复制深证100指数的情况,将采用剩余组合替换等方法避免跟踪误差扩大。
业绩比较基准	深证100指数收益率×95%+银行间业存款利率×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(2014年4月1日 - 2014年6月30日)
1.本期已实现收益	-397,474,547.02
2.本期利润	357,671,775.47
3.加权平均基金份额本期利润	0.0271
4.期末基金资产净值	11,134,746,662.08
5.期末基金份额净值	0.853

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;

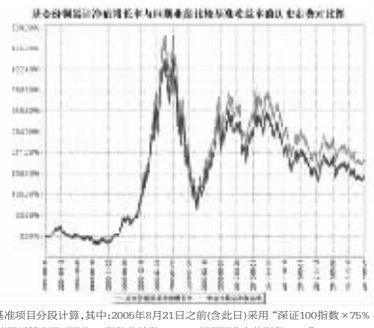
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	3.27%	0.87%	3.51%	0.86%	-0.24%	0.01%

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:本基金业绩比较基准项目分段计算,其中:2005年8月21日之前(含此日)采用“深证100指数×75%+银行间债券综合指数×25%”,2005年8月22日起使用新基准即“深证100指数收益率×95%+银行间业存款利率×5%”。

§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		
王建强	本基金的基金经理、融通巨潮100指数基金(LOF)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 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、《融通通利系列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

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,竭力通过控制股票投资权重与深证100指数成份股自然权重的偏离,减少基金相对深证100指数的跟踪误差,力求最终实现对深证100指数的有效跟踪。

2014年第2季度证券市场整体波动较小,成长风格资产波动较为剧烈,大盘综合指数中沪深300指数微涨0.88%,创业板指数上涨5.79%。从中信行业类指数的表现来看:国防军工行业涨幅16.56%,计算机涨幅14.12%、通信行业涨幅10.01%、传媒行业涨幅9.29%、电子元器件行业涨幅9.22%;而纺织服装、食品饮料、商贸零售、交通运输等与消费相关的行业均下跌。

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3.27%,同期业绩比较基准收益率为3.51%。

§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	10,502,747,996.96	94.04
	其中:股票	10,502,747,996.96	94.04
2	固定收益投资	541,810,000.00	4.85
	其中:债券	541,810,000.00	4.85
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	26,371,839.52	0.24
7	其他资产	97,049,518.75	0.87
8	合计	11,167,979,355.23	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	28,778,668.80	0.26
B	采矿业	244,921,057.44	2.20
C	制造业	6,206,375,306.73	55.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	90,627,384.50	0.81
E	建筑业	105,948,858.24	0.95
F	批发和零售业	208,966,313.76	1.88
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	802,664,147.23	7.21
J	金融业	1,113,049,290.02	10.00
K	房地产业	812,612,661.95	7.30
L	租赁和商务服务业	210,653,662.64	1.89
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	332,204,271.25	2.98
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	253,567,989.26	2.28
S	综合	92,378,385.14	0.83
	合计	10,502,747,996.96	94.32

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	000002	万 科A	66,762,340	552,124,551.80	4.96
2	000651	格力电器	17,749,533	522,723,746.85	4.69
3	000001	平安银行	38,954,254	386,036,657.14	3.47
4	000333	美的集团	14,249,452	275,299,412.64	2.47
5	000858	五 粮 液	13,860,084	248,511,306.12	2.23
6	000776	广发证券	22,782,486	223,268,362.80	2.01
7	002024	苏宁云商	31,854,621	208,966,313.76	1.88
8	000063	中兴通讯	15,343,928	201,312,335.36	1.81
9	000625	长安汽车	14,758,415	181,676,088.65	1.63
10	000895	双汇发展	4,898,607	175,321,144.53	1.57

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	541,810,000.00	4.87
	其中:政策性金融债	541,810,000.00	4.87
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	541,810,000.00	4.87

5.5 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	140429	14农发29	2,000,000	200,740,000.00	1.80
2	140207	14国开07	2,000,000	200,720,000.00	1.80
3	140430	14农发30	1,000,000	100,350,000.00	0.90
4	130227	13国开27	400,000	40,000,000.00	0.36

5.6 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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未投资股指期货。

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

本基金本报告期未投资国债期货。

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

本基金本报告期未投资国债期货。

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本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本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	923,305.97
2	应收证券清算款	87,180,794.00
3	应收股利	-
4	应收利息	6,847,904.71
5	应收申购款	2,097,514.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	97,049,518.75

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 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部分前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 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

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	13,354,033,030.10
报告期期间基金总申购份额	302,789,489.84
减:报告期期间基金总赎回份额	608,031,751.55
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	13,048,790,768.39

§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

8.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准融通通利系列证券投资基金设立的文件

(二)《融通通利系列证券投资基金基金合同》

(三)《融通通利系列证券投资基金托管协议》

(四)《融通通利系列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www.rtfund.com查询。

融通基金管理有限公司

二〇一四年七月二十一日

融通通利系列证券投资基金之融通债券投资基金

【2014】第二季度报告

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7月21日

§1 重要提示

融通通利系列证券投资基金由融通债券投资基金、融通深证100指数证券投资基金和融通蓝筹成长证券投资基金共同构成。本报告为融通通利系列证券投资基金之子基金融通债券投资基金(以下简称“本基金”)2014年第2季度报告。

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《融通通利系列证券投资基金基金合同》规定,于2014年7月15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2014年4月1日起至2014年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通债券	
交易代码	161603	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2003年9月30日	
报告期末基金份额总额	905,956,116.87份	
投资目标	在强调本金安全的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	以组合优化为基本策略,利用收益曲线模型和债券品种定价模型,在获取较好的稳定收益的基础上,捕捉市场出现的中短期投资机会。	
业绩比较基准	中信标普全债指数收益率	
风险收益特征	属于相对低风险的基金品种	
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	
下属两级基金的基金简称	融通债券A/B类	融通债券C类
下属两级基金的交易代码	161603	161693
下属两级基金的前端交易代码	161603	161693
下属两级基金的后端交易代码	161653	-
报告期末下属两级基金的份额总额	377,783,450.93份	528,172,665.94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(2014年4月1日 - 2014年6月30日)	
	融通债券A/B类	融通债券C类
1.本期已实现收益	5,684,075.76	5,039,908.83
2.本期利润	14,562,948.10	12,893,661.06
3.加权平均基金份额本期利润	0.0413	0.0384
4.期末基金资产净值	398,695,972.88	556,515,983.99
5.期末基金份额净值	1.055	1.054

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

1、融通债券A/B类

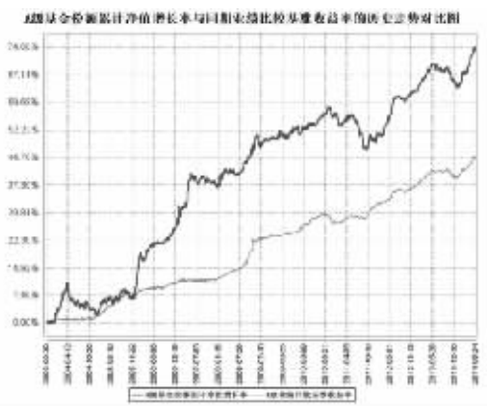
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.15%	0.08%	2.41%	0.04%	1.74%	0.04%

2、融通债券C类

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	4.15%	0.08%	2.41%	0.04%	1.74%	0.04%

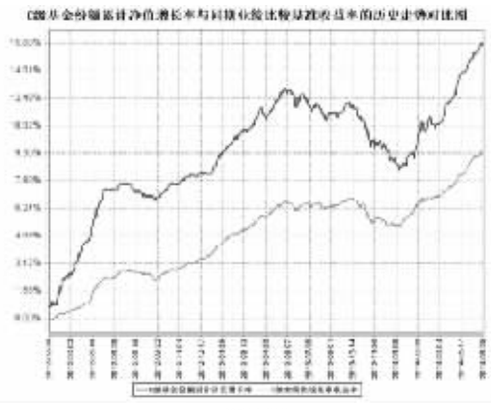
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

1、融通债券A/B类



注:本基金A类基金份额业绩比较基准项目分段计算,其中:2009年12月31日(含此日)之前采用“银行间债券综合指数”,2010年1月1日起使用新基准即“中信标普全债指数收益率”。

2、融通债券C类



§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		
韩海平	本基金的基金经理、融通通福分级债及融通通泰保本混合的基金经理、固定收益部总监	2013年12月19日	-	11	韩海平先生,CFA、FRM,中国科学技术大学经济学硕士;管理科学和计算机科学与技术双学士,具有证券从业资格。2003年10月至2007年4月在招商基金管理有限公司工作,从事数量化投资策略研究工作;2007年5月至2012年9月在国投瑞银基金管理有限公司工作,历任高级研究员、基金经理、固定收益组副总监;2012年9月加入融通基金管理有限公司。
王超	本基金的基金经理、融通标普可转债指数的基金经理	2013年12月27日	-	7	金融工程硕士,经济学、数学双学士,具有基金从业资格。2007年7月至2012年8月在深圳发展银行(现更名为平安银行)工作,主要从事债券自营交易盘投资与理财投资管理。2012年8月加入融通基金管理公司任投资经理。

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工作的时间为计算标准。

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、《融通通利系列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

2014年2季度,资金面依然较为宽松,央行在此期间进行了两次定向降准,在5、6月份通过公开市场进行了资金投放,整个2季度的资金面大幅宽松,银行间质押式回购利率中枢始终维持在低位水平,且资金面非常平稳,回购利率波动幅度很小,从而推动了债券市场收益率大幅度下行。

投资方面,本基金在2季度继续加强了对高资质债券品种的配置,降低了低评级