

## 融通深证成份指数证券投资基金

### 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

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。

本报告自2014年4月1日起至6月30日止。

#### § 2 基金产品概况

基金简称	融通深证成份指数
交易代码	161612
前端交易代码	161612
后端交易代码	161662
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年11月15日
报告期末基金份额总额	844,850,358.41份
投资目标	本基金为被动式指数基金,通过采用完全复制指数的投资策略,跟踪标的指数的表现,追求跟踪标的指数净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.35%,年化跟踪误差控制在0.5%以内,以实现对中证成份指数的有效投资。
投资策略	本基金为被动式指数基金,原则上采用完全复制指数的投资策略,将标的指数的成份股及其权重复制到投资组合内,并定期或不定期调整投资组合使其与标的指数相符合。本基金在严格控制跟踪误差的前提下,综合运用多种投资策略,力求实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.35%,年化跟踪误差控制在0.5%以内的投资目标。
业绩比较基准	深证成份指数收益率×95%+银行同期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,属于中高风险收益的基金品种,其收益和风险均高于货币型基金,低于混合型基金和股票型基金。
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

#### § 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2014年4月1日至2014年6月30日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	-19,379,273.02	
2.本期利润	16,098,115.04	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0193	
4.期末基金资产净值	523,526,340.02	
5.期末基金份额净值	0.620	

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	3.16%	0.84%	2.05%	0.86%	1.11%	-0.02%

##### 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

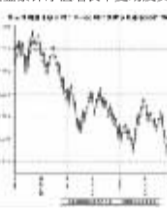


图 4 管理人报告

姓名	职务	任本基金的基金经理期间 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
李勇	本基金的基金经理,融通深证成份指数基金基金经理	2010年11月15日	-	9	研究生学历,具有证券从业资格,2005年至2007年任职于融通基金管理有限公司,历任基金经理、研究员、基金助理等职务。
王强	本基金的基金经理,融通深证成份指数基金基金经理	2010年11月15日	-	10	本科学历,具有基金从业资格,2005年至2007年任职于融通基金管理有限公司,历任基金经理、研究员、基金助理等职务。

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的工作时间为计算标准。

#### 4.2 管理人报告期内本基金运作遵守信情况的说明

本报告内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《融通深证成份指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定,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,为基金份额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制度和流程。

##### 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

本基金为被动式指数基金,原则上采用完全复制指数的投资策略,按照成份股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股及其权重的变化进行相应调整,力争实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于0.35%,年化跟踪误差控制在0.5%的投资目标。

##### 4.5 报告期内基金的业绩表现

2014年二季度融通深证成份指数基金上涨3.16%,同期业绩比较基准上涨2.05%。沪深300上涨0.89%,从各主要行业指数表现来看:国防军工(申万)、通信(申万)和计算机(申万)领涨,交通运输(申万)、食品饮料(申万)和纺织服装(申万)领跌。

#### § 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	488,776,310.60	93.08
	其中:股票	488,776,310.60	93.08
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	27,270,128.40	5.19
7	其他资产	9,076,508.56	1.73
8	合计	525,123,011.99	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	10,084,168.22	1.93
C	制造业	295,577,389.50	56.42
D	电力、热力、燃气及生产和服务供应业	-	-
E	建筑业	7,763,899.68	1.48
F	批发和零售业	17,712,885.60	3.38
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	-	-
J	金融业	75,641,125.66	14.45
K	房地产业	61,936,149.21	11.83
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	20,260,692.73	3.87
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		488,776,310.60	93.36

##### 5.2.2 报告期末非指数投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末无非指数投资部分股票。

##### 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

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	5,591,191	46,239,149.57	8.83
2	000651	格力电器	1,508,721	44,431,833.45	8.49
3	000001	平安银行	3,258,942	32,296,115.22	6.17
4	000033	荣信股份	1,185,575	22,995,399.00	4.38
5	000858	五矿资本	1,164,545	20,880,291.35	3.99
6	000776	广发证券	1,885,800	18,480,840.00	3.53
7	000204	苏宁云商	2,700,135	17,712,885.60	3.38
8	000663	中兴通讯	1,186,954	15,572,836.48	2.97
9	000895	双汇发展	406,448	14,561,089.92	2.78
10	002415	海康威视	855,244	14,487,833.36	2.77

##### 5.3.2 报告期末非指数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非指数投资部分股票。

##### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

##### 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

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

##### 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

本基金本报告期末未投资国债期货。

##### 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

本基金本报告期末未投资国债期货。

##### 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	52,152.65
2	应收证券清算款	9,017,104.11
3	应收股利	-
4	应收利息	4,876.81
5	应收申购款	22,374.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,076,508.56

##### 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。

##### 5.11.6 报告期末非指数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非指数投资部分股票。

#### § 6 开放式基金份额变动

报告期初基金份额总额	883,598,955.85
报告期基金份额变动	6,266,272.11
报告期基金份额变动明细	45,019,609.55
报告期基金份额变动明细	844,850,358.41

#### § 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情况。

#### § 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深证成份指数证券投资基金设立的文件

(二)《融通深证成份指数证券投资基金基金合同》

(三)《融通深证成份指数证券投资基金托管协议》

(四)《融通深证成份指数证券投资基金招募说明书》

(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  
二〇一四年六月二十一日

## 融通四季添利债券型证券投资基金

### 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

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。

本报告自2014年4月1日起至6月30日止。

#### § 2 基金产品概况

基金简称	融通四季添利债券
基金代码	161614
交易代码	161614
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月1日
报告期末基金份额总额	195,067,614.62份
投资目标	在严格控制投资风险的基础上,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将在基金合同约定的投资范围内,通过对宏观经济状况、利率走势、信用风险和流动性风险进行综合分析,在有效控制风险的基础上,获得基金资产的稳定增值。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金属于债券基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金、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

#### § 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2014年4月1日至2014年6月30日)
1.本期已实现收益	3,797,355.33
2.本期利润	13,360,255.85
3.加权平均基金份额本期利润	0.0567
4.期末基金资产净值	202,480,935.07
5.期末基金份额净值	1.038

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	5.83%	0.13%	2.42%	0.08%	3.41%	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



图 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间 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
蔡奕荣	本基金的基金经理,融通四季添利债券基金基金经理	2012年3月1日	-	8	管理科学硕士,具有证券从业资格,2005年12月至2006年11月,任职于万家基金管理有限公司,担任交易员职务;2006年12月至2008年8月,任职于银河基金管理有限公司,担任交易员职务;2008年9月至2009年9月,任职于融通基金管理有限公司,担任交易员、行业研究员职务。

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的工作时间为计算标准。

#### 4.2 管理人报告期内本基金运作遵守信情况的说明

本报告内,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、《融通四季添利债券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,为基金份额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制度和流程。

##### 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2014年二季度宏观经济数据依然低迷,政策持续释放微刺激和宽松货币信号,定向降准、127号文等均带动了市场的做多情绪,债市延续了牛市行情。在非标的规模减少以及信贷回表的带动下,以银行配置盘为主的机构投资者在二季度加大了债券的配置力度。利率债收益率降幅在30bp-50bp,收益率曲线进一步平坦化,信用债中城投表现最佳,收益率普遍降幅在50bp-80bp,信用利差进一步收窄。本基金继续保持较为积极的投资策略,维持较高的组合杠杆水平。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期融通四季添利定期开放债券A类份额净值增长率为5.05%,融通四季添利定期开放债券B类份额净值增长率为4.95%,同期业绩比较基准收益率为7.05%。

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

进一步平坦化,信用债中5档表现最佳,收益率普遍降维在50bp-80bp,信用利差进一步收窄。本基金继续保持较为积极的投资策略,维持较高的组合杠杆水平。

4.5 报告期内基金的投资表现

---

## 债券型证券投资基金