

融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)

【2014】半年度报告摘要

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
送出日期:2014年8月26日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)基金合同规定,于2014年8月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2014年1月1日起至2014年6月30日止。

2.1 基金基本情况

基金名称	融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)
融通巨潮100指数(LOF)	
场内简称	融通巨潮
基金代码	161607
前次交易代码	161607
基金运作方式	上市型开放式基金(LOF)
基金合同生效日	2005年5月12日
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
报告期末基金份额总额	2,243,078,334.12份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2005年6月16日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型指数基金,在控制投资组合相对目标1000只和跟踪误差的基础上,力求取得超越1000只指数的投资收益,追求长期的资本增值,本基金追求分享中国经济的持续、稳定增长和中国经济市场发展的成果,实现基金资产的长期增长,为投资者带来稳定的回报。
投资策略	本基金以数量化分散投资为主要投资策略,在基金资产净值稳定的前提下,在股票资产及股指期货投资的基础上,通过股指期货套期保值及股指期货套利等方式,在控制基金跟踪目标指数的跟踪误差的前提下,力争实现基金资产净值增长率与目标指数增长率相接近的长期投资目标。
业绩比较基准	巨潮1000指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。
风险收益特征	风险和预期收益水平接近市场平均水平。

2.3 基金管理人及基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	融通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名: 张卫华 联系电话: (0755) 12048666 电子邮箱: service@mfund.com.cn	姓名: 张卫华 联系电话: (0755) 12048666 电子邮箱: service@mfund.com.cn
客户服务电话	400-883-8088、(0755) 12048088	95588
网址	(0755) 12035005	(010) 66105798

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、证券日报
登载基金半年度报告正文的互联网网址	http://www.fund.com

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

金额单位:人民币元

项目	报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)
3.1.1 期间损益和指标	
本期已实现收益	-74,754,403.26
本期利润	-104,639,549.69
加权平均基金份额本期利润	-0.0452
本期基金份额净值增长率	-6.14%
3.1.2 期末数据和指标	
期末可供分配基金份额利润	-0.4578
期末基金资产净值	1,510,804,419.33
期末基金份额净值	0.673

注:(1)所述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;

(2)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)期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润-期末基金份额总额,其中:期末可供分配利润:如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分)扣除未实现部分。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率(%)	业绩比较基准收益率(%)	①-②	②-①
过去一个月	1.05%	0.72%	0.33%	-0.01%
过去三个月	1.97%	0.85%	1.12%	0.01%
过去六个月	-6.14%	0.98%	-6.48%	0.01%
过去一年	-2.18%	1.15%	-1.88%	0.01%
过去二年	-24.89%	1.24%	-21.90%	0.01%
自基金合同生效起至今	124.14%	1.73%	142.98%	0.00%

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

④ 管理人报告

4.1 基金管理人及基金基本情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

融通基金管理有限公司(以下简称“本公司”)经中国证监会证监基字[2001]10号文批准,于2001年5月22日成立,公司注册资本12500万元人民币。本公司的股东及出资比例:新时代证券有限责任公司60%、日兴资产管理(中国)有限公司(Nikko Asset Management Co., Ltd.)40%。

截至2014年6月30日,公司管理的基金共有二十五只:一只封闭式基金,即融通封闭基金;二十四只开放式基金,即融通新蓝筹混合基金、融通债券基金、融通深证100指数基金、融通蓝筹成长混合基金、融通行业景气混合基金、融通巨潮100指数基金(LOF)、融通货币支付货币基金、融通动力先锋股票基金、融通领先成长股票基金(LOF)、融通内需驱动股票基金、融通深证300指数基金、融通四季添利股票基金、融通创业板指数基金、融通医疗保健行业股票基金、融通岁岁添利定期开放债券基金、融通丰利4分法(ODI+POF)基金、融通七天理财债券基金、融通标普中国可转债指数增强基金、融通通泰保本混合基金、融通通祥一年目标收益混合基金、融通通祥一年目标收益双混合基金、融通通福分级债券基金、融通通源一年目标收益双混合基金和融通通源一年目标收益双债券型证券投资基金。其中,融通债券基金、融通深证100指数基金和融通蓝筹成长混合基金同属融通系列证券投资基金。此外,公司还开展了特定客户资产管理业务。

4.2 基金业绩(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
王建华	本基金基金经理、融通巨潮100指数证券投资基金基金经理、融通蓝筹成长混合基金基金经理、融通行业景气混合基金基金经理、融通动力先锋股票基金基金经理、融通领先成长股票基金基金经理、融通内需驱动股票基金基金经理、融通深证300指数基金基金经理、融通四季添利股票基金基金经理、融通创业板指数基金基金经理、融通医疗保健行业股票基金基金经理、融通岁岁添利定期开放债券基金基金经理、融通丰利4分法(ODI+POF)基金基金经理、融通七天理财债券基金基金经理、融通标普中国可转债指数增强基金基金经理、融通通泰保本混合基金基金经理、融通通祥一年目标收益混合基金基金经理、融通通祥一年目标收益双混合基金基金经理、融通通福分级债券基金基金经理、融通通源一年目标收益双混合基金基金经理、融通通源一年目标收益双债券型证券投资基金基金经理	2009年5月15日至2014年6月30日	10	本科学历,具有证券从业资格,2001年至2004年担任融通基金基金经理,2004年至2006年担任融通基金基金经理,2006年至2008年担任融通基金基金经理,2008年至2010年担任融通基金基金经理,2010年至2012年担任融通基金基金经理,2012年至2014年担任融通基金基金经理。

注:在任职期间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 管理人报告期内本基金运作遵守信守情况的说明

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,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。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 管理人报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直严格执行对旗下所有投资组合的原则,在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。

4.4 管理人报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 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,力求最终实现与巨潮100指数基金基准的有效跟踪。

4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期末巨潮100指数基金份额净值下跌6.14%,同期业绩比较基准下跌6.48%,报告期内费用计提及交易成本是构成基金净值与基准之间误差的主要原因。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年上半年整体市场表现继续成长风格大幅度领先,大盘蓝筹等受实体经济下行趋势影响较大的化工、金融、房地产相关行业表现疲弱。上半年大盘蓝筹指数呈现波动收敛的特性,而创业板为代表的成长股则呈现了冲高、回落、调整结构再冲高的特征。展望下半年的市场,我们认为除非出现大幅超预期的系统性的市场化改革方案,否则成长股难以继续领涨,但传统低估值蓝筹可能有一定的区域反弹。在微刺激环境下,我们依然认为中国结构性改革转型所面临的中长期问题并未得到缓解,甚至有可能面临反反复复的进程和二三线房地产市场继续调整,部分地方民生的债务风险可能面临低烈度爆发的风险。外部环境四季度至年底美联储加息的态度将继续影响全球流动性的变化,对国内货币政策也将有所影响。总体而言,三、四季度之交是风险和机会的分水岭,在此之前,成长股风险大于机会,在此之后,低估值蓝筹机会大于风险。

4.6 管理人报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金的估值业务严格按照《融通基金管理有限公司证券投资基金估值业务原则和程序》进行,公司设立由研究部、风险管理部、登记结算部、固定收益部、国际业务部和监察稽核部指定人员共同组成的估值委员会,通过参考行业协会意见、参考独立第三方机构估值数据等多种方式的有效结合,减少或避免估值偏差的发生。估值委员会的相关人员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历,估值委员会定期不包含基金经理。

估值委员会定期或不定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价,在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法,以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经公司总经理办公会议审议批准后方可实施。基金在采用新投资策略或投资品种时,应评价现有估值政策和程序的适用性。其中研究部负责定期对新投资策略是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价,风险管理部负责估值方法的研究、计算及复核,登记结算部负责具体的估值核算并计算每日基金净值,每日对基金估值数据的相关信息、基金估值方法的有效性进行搜集并整理汇总,估值委员会参考、监察稽核部负责基金估值业务的审核、审计及事后稽核工作。基金经理不参与估值定价,参与估值流程各方之间亦不存在任何重大利益冲突,截至报告期末公司与外部估值定价服务机构均签约。

4.7 管理人报告期内基金利润分配情况的说明

截至2014年6月30日,本基金每基金份额可供分配利润为-0.4578元,根据基金合同的约定,本报告期不进行利润分配。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵守信守情况声明

2014年上半年,本基金托管人在对融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2014年上半年,融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)的管理人——融通基金管理有限公司在融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的有关规定进行。本报告期内,融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对融通基金管理有限公司编制和披露的融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)2014年上半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上报告真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)

报告截止日:2014年6月30日

资产	本报告期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
货币		
银行存款	19,824,360.15	24,791,316.25
结算备付金	160,324.85	791,810.07
存出保证金	145,618.35	200,057.94
交易性金融资产	1,501,137,667.56	1,685,966,142.15
其中:股票投资	1,404,888,667.56	1,606,470,142.15
基金投资	-	-
债券投资	70,249,000.00	79,496,000.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	984,378.31	-
应收利息	738,377.50	1,837,800.03
应收股利	-	-
应收申购款	14,945.14	45,027.88
递延所得税资产	-	-
其他资产	30,347.10	-
资产总计	1,520,044,918.96	1,713,722,154.32
负债和所有者权益		
负债		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
应付证券清算款	-	-
应付利息	7,185,322.97	-
应付赎回款	2,484,329.23	1,382,312.01
应付管理人报酬	1,612,572.44	1,934,479.73
应付托管费	248,088.06	297,673.82
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	262,671.85	548,731.22
应交税费	-	-
应付股利	-	-
其他负债	-	-
负债合计	12,240,499.63	4,765,400.44
所有者权益		
实收基金	2,243,878,334.12	2,382,388,063.65
未分配利润	-733,073,914.79	-673,431,369.77
所有者权益合计	1,510,804,419.33	1,708,956,733.87
负债和所有者权益总计	1,520,044,918.96	1,713,722,154.32

注:报告期末截止2014年6月30日,基金份额净值0.673元,基金份额总额2,243,878,334.12份。

6.2 利润表

会计主体:融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	本报告 2014年1月1日至 2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年6月30日
一、收入	-91,972,637.13	-262,287,862.14
1.利息收入	1,340,695.76	1,302,302.31
其中:存款利息收入	95,942.27	136,074.99
债券利息收入	1,244,953.43	1,165,327.32
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益	-63,444,077.02	-76,697,977.08
其中:股票投资收益	-82,234,107.02	-103,513,427.99
基金投资收益	-	-
债券投资收益	280,640.00	800,970.71
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
公允价值变动收益	18,510,090.10	26,014,480.20
3.公允价值变动收益	-29,885,146.43	-186,927,777.27
4.其他收益	-	-
5.其他收入	15,690.62	35,590.00
减:二、费用	12,666,912.56	17,549,542.03
1.管理人报酬	10,060,236.57	13,386,846.65
2.托管费	1,547,727.85	2,699,514.78
3.销售服务费	-	-
4.其他费用	828,049.38	1,915,405.80
5.其他:卖出回购金融负债支出	-	-
6.其他费用	230,604.79	187,774.80
三、利润总额	-104,639,549.69	-279,837,404.17
减:所得税费用	-	-
四、净利润	-104,639,549.69	-279,837,404.17

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	本报告 2014年1月1日至 2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	2,382,388,063.65	-673,431,369.77
二、本期综合收益总额	-91,972,637.13	-262,287,862.14
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动	-138,509,729.53	44,966,947.67
其中:1.基金申购款	28,909,038.92	-49,945,952
2.基金赎回款	-167,508,768.45	54,462,435.19
三、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,243,878,334.12	1,510,804,419.33
一、期初所有者权益(基金净值)	2,674,500,957.78	-59,649,988.92
二、本期综合收益总额	-2,674,500,957.78	-279,837,404.17
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动	-130,757,051.66	25,943,457.83
其中:1.基金申购款	49,631,107.34	-9,965,052.57
2.基金赎回款	-180,388,159.00	35,908,510.40
三、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,543,743,906.12	1,750,199,970.86

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

吴建华 _____ 朱建华 _____ 刘美丽 _____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告保持一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.2 会计政策变更和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告与本基金发生关联交易的各关联方

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联交易

6.4.4.1 股票交易

6.4.4.1.1 关联交易

6.4.4.1.2 关联交易

6.4.4.1.3 关联交易

注:1、上述股票按市场公允价值计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证券费和经手费的净额列示。关联交易不列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.4.2 基金关联方

6.4.4.2.1 基金关联方

6.4.4.2.2 基金关联方

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年6月30日
报告期发生的基金应支付的管理费	10,060,236.57	13,386,846.65
其中:支付销售机构的客户维护费	1,977,859.70	2,699,514.95

注:1.支付基金管理人融通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.3%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:
日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.3%÷当年天数。
2.客户维护费是基金管理人根据销售机构约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的费用,用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支,不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
报告期发生的基金应支付的托管费	1,547,727.85	2,699,514.78

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.2%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:
日托管费=前一日基金资产净值×0.2%÷当年天数。
6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间,本基金均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间,基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末,基金管理人、基金管理人主要股东及受其控制的机构均未持有本基金份额。

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
中国工商银行股份有限公司	期末余额 19,824,360.15	期末余额 24,791,316.25
	当期利息收入 89,715.40	当期利息收入 9,494,866.33
		127,271.89

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1. 本基金在承销期及上年度可比期间均未买入管理人、托管人的控股股东在承销期内担任副承销商或承销商承销的证券;

2. 本基金本报告期及上年度可比期间均未买入管理人、托管人的主要股东(非控股)在承销期承销的证券。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项的说明。

6.4.5 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌原因	期末 持仓数量 (股)	期末 持仓成本 (元)	期末 持仓市值 (元)	备注
60063	百润酒	2014年5月29日	32.00	-	290,742	10,797,129.36
00056	2	2013年10月31日	8.22	8.95	576,904	4,835,274.96
					4,742,150.88	-

注:本基金截至2014年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

6.4.5.3 期末债券正回购及作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因从事银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因从事交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

2	其中:股票	1,430,888,667.56	93.95
3	固定收益投资	70,249,000.00	4.61
	其中:债券	70,249,000.00	4.61
	资产支持证券	--	--
5	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	19,993,685.00	1.31
7	其他各项资产	1,913,566.40	0.13
8	合计	1,523,044,918.96	100.00