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】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

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。本报告摘要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年半年度报告摘要。

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《融通通利系列证券投资基金基金合同》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、利润分配情况、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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	融通深证100指数
基金主代码	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
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	13,048,790,768.39份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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	以非债券资产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%+银行同业存款利率×5%
风险收益特征	风险和预期收益率接近市场平均水平

2.3 基金管理人和基金托管人

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	涂卫东	赵会军
	联系电话	(0755)26948666	(010)66105799
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-883-8088,(0755)26948088	95588
传真		(0755)26935005	(010)66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	-419,905,802.68
本期利润	-828,449,774.28
加权平均基金份额本期利润	-0.0619
本期基金份额净值增长率	-6.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1751
期末基金资产净值	11,134,746,662.08
期末基金份额净值	0.853

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)。

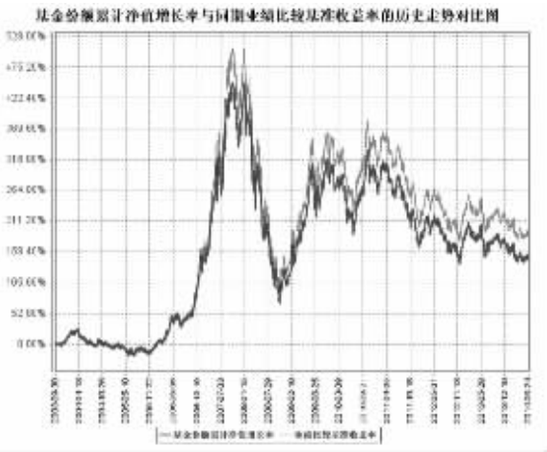
3.2 基金净值表现

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①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	1.55%	0.87%	1.61%	0.86%	-0.06%	0.01%
过去三个月	3.27%	0.87%	3.51%	0.86%	-0.24%	0.01%
过去六个月	-6.67%	1.09%	-6.31%	1.09%	-0.36%	0.00%
过去一年	-0.93%	1.18%	-0.09%	1.17%	-0.84%	0.01%
过去三年	-32.62%	1.33%	-30.61%	1.33%	-2.01%	0.00%
自基金合同生效起至今	152.04%	1.71%	193.45%	1.72%	-41.41%	-0.01%

注:本报告中的基金业绩比较基准表现分段计算,其中:2005年8月21日(含此日)之前采用“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%+银行同业存款利率×5%”。

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变动的比较



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

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]8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。本公司的股东及其出资比例为:新时代证券有限责任公司60%、日兴资产管理有限公司(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,即融通通乾封闭基金;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)、融通易支付货币基金、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、融通深证成份指数基金、融通四季添利债券基金、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、融通丰利四分法(QDII-FOF)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、融通通泽一年目标触发式混合基金、融通通祥一年目标触发式混合基金、融通通福分级债券基金、融通通源一年目标触发式混合基金和融通通瑞一年目标触发式债券基金。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通利系列证券投资基金。此外,公司还开展了特定客户资产管理业务。

4.1.2 基金经理(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期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
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 管理人对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

本基金管理人一直坚持公平对待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。

本基金管理人对报告期内不同时间窗下(日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析,各投资组合的同向交易价差均处于合理范围之内。

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 管理人对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,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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金净值增长率为-6.67%,业绩比较基准收益率为-6.31%。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 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年上半年的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重化工、金融、房地产相关行业表现较弱。上半年大盘蓝筹指数呈现波动收窄的特性,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较好的区间反弹。在微刺激环境下,我们依然认为中国经济结构性转型所面临的中长期问题并未得到缓解,甚至有可能随着反腐的进行和二三线房地产市场的继续调整,部分地方民企的债务风险可能出现低烈度爆发的风险。外部环境四季度至年底美联储对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 管理人对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、登记清算部、固定收益部、国际业务部和监察稽核部共同组成的估值委员会,通过参考行业协会估值意见、参考独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合,减少或避免估值偏差的发生。估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历,估值委员会成员不包含基金经理。

估值委员会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批后方可实施。基金在采用新投资策略或投资新品种时,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,金融工程小组负责估值方法的研究、价格的计算及复核,登记清算部进行具体的估值核算并计算每日基金净值,每日对基金所投资品种的公开信息、基金会计估值方法的法规等进行搜集并整理汇总,供估值委员会参考,监察稽核部负责基金估值业务的事前、事中及事后的审核工作。基金经理不参与估值决定,参与估值流程各方之间亦不存在任何重大利益冲突,截至报告期末公司未与外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对融通深证100指数证券投资基金的托管过程中,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

本报告期内,融通深证100指数证券投资基金的管理人——融通基金管理有限公司在融通深证100指数证券投资基金的投资运作、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规定进行。本报告期内,融通深证100指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、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深证100指数证券投资基金2014年上半年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,以上内容真实、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:融通深证100指数证券投资基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资产:		
银行存款	23,006,456.30	230,936,436.00
结算备付金	3,365,383.22	1,530,832.85
存出保证金	923,305.97	737,471.32
交易性金融资产	11,044,557,996.96	12,357,377,482.34
其中:股票投资	10,502,747,996.96	11,780,611,482.34
基金投资	-	-
债券投资	541,810,000.00	576,766,000.00
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	-	43,750,221.88
应收证券清算款	87,180,794.00	-
应收利息	6,847,904.71	13,861,978.32
应收股利	-	-
应收申购款	2,097,514.07	5,497,856.08
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	11,167,979,355.23	12,653,692,278.79
负债和所有者权益	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	91,103,302.93
应付赎回款	17,883,527.73	15,886,823.09
应付管理人报酬	9,068,425.89	10,914,468.17
应付托管费	1,813,685.16	2,182,893.62
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,705,191.97	3,419,933.65
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,761,862.40	2,048,011.31
负债合计	33,232,693.15	125,555,432.77
所有者权益:		
实收基金	13,048,790,768.39	13,700,692,357.66
未分配利润	-1,914,044,106.31	-1,172,555,511.64
所有者权益合计	11,134,746,662.08	12,528,136,846.02
负债和所有者权益总计	11,167,979,355.23	12,653,692,278.79

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值0.853元,基金份额总额13,048,790,768.39份。

6.2 利润表

会计主体:融通深证100指数证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

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
一、收入	-753,076,375.86	-1,276,744,166.67
1.利息收入	10,018,855.83	9,984,798.35
其中:存款利息收入	603,328.41	702,101.36
债券利息收入	9,411,802.75	9,281,188.63
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3,724.67	1,508.36
其他利息收入	-	-
2.投资收益	-354,805,519.77	-315,777,935.30
其中:股票投资收益	-483,879,775.01	-422,528,289.05
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,505,681.92	20,000.00
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	127,568,573.32	106,730,353.75
3.公允价值变动收益	-408,543,971.60	-971,522,543.04
4.汇兑收益	-	-
5.其他收入	254,259.68	571,513.32
减:二、费用	75,373,398.42	95,720,962.13
1.管理人报酬	56,766,788.72	72,782,395.28
2.托管费	11,353,357.75	14,556,479.05
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	7,096,595.09	8,220,957.32
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	156,656.86	161,130.48
三、利润总额	-828,449,774.28	-1,372,465,128.80
减:所得税费用	-	-
四、净利润	-828,449,774.28	-1,372,465,128.80

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:融通深证100指数证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	13,700,692,357.66	-1,172,555,511.64	12,528,136,846.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-828,449,774.28	-828,449,774.28
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-651,901,589.27	86,961,179.61	-564,940,409.66
其中:1.基金申购款	709,563,221.65	-101,307,511.43	608,255,710.22
2.基金赎回款	-1,361,464,810.92	188,268,691.04	-1,173,196,119.88
四、本期向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)	13,048,790,768.39	-1,914,044,106.31	11,134,746,662.08
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	15,247,940,461.07	-699,966,838.68	14,547,973,622.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,372,465,128.80	-1,372,465,128.80
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-303,117,197.93	1,968,306.86	-301,148,891.07
其中:1.基金申购款	1,520,034,869.17	-35,100,940.97	1,484,933,928.20
2.基金赎回款	-1,823,152,067.10	37,069,247.83	-1,786,082,819.27
四、本期向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)	14,944,823,263.14	-2,070,463,660.62	12,874,359,602.52

注:后附6.4报表附注为本财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:奚星华 主管会计工作负责人:朱建华 会计机构负责人:刘美丽

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相一致的说明

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 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 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
融通基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行	基金托管人、基金代销机构
新时代证券有限责任公司(“新时代证券”)	基金管理人股东、基金代销机构

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方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未租用关联方的交易单元。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

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
当期发生的基金应支付的管理费	56,766,788.72	72,782,395.28
其中:支付销售机构的客户维护费	7,212,921.42	9,039,244.40

注:1、支付基金管理人融通基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值1.00%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:日基金管理费=前一日基金资产净值×1.00%÷当年天数。

2、客户维护费是基金管理人与基金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
当期发生的基金应支付的托管费	11,353,357.75	14,556,479.05

注:支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.20%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:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20% / 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

本基金本报告期及上年度可比期间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,基金管理人主要股东及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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	23,006,456.30	531,947.10	207,879,080.03	558,980.74

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、本基金本报告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主承销商或分销商所承销的证券。

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	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000009	中国宝安	2014-5-28	重大事项	10.21	2014-8-15	10.26	9,047,834	87,150,738.02	92,378,385.14	-
005562	宏源证券	2013-10-31	资产重组	8.22	2014-7-28	8.93	10,691,333	116,509,025.68	87,882,757.26	-
002570	贝因美	2014-6-19	重大事项	14.36	-	-	4,942,352	91,614,406.15	70,972,174.72	-
000960	锡业股份	2014-5-6	资产重组	12.44	2014-8-5	13.68	4,046,940	82,404,483.37	50,343,933.60	-
000878	云南铜业	2014-4-17	重大事项	7.61	2014-7-17	7.50	6,298,504	161,371,670.32	47,931,615.44	-

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

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 投资组合报告

7.1 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	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	其他各项资产	97,049,518.75	0.87
8	合计	11,167,979,355.23	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

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

7.2.2 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。

7.2 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

7.2.3 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	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

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于基金管理人融通基金管理有限公司网站(http://www.rtfund.com)的半年度报告正文。

7.2.4 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。

7.3 报告期内股票投资组合的重大变动

7.3.3 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300058	蓝色光标	100,652,663.67	0.80
2	300017	网宿科技	97,300,788.03	0.78
3	002465	海格通信	89,885,618.57	0.72
4	300124	汇川技术	85,815,543.90	0.68
5	002065	东华软件	80,003,757.86	0.64
6	300002	神州泰岳	75,152,711.45	0.60
7	002385	大北农	67,183,605.89	0.54
8	000625	长安汽车	64,456,921.21	0.51
9	000831	五矿稀土	63,925,578.00	0.51
10	300024	机器人	56,418,522.48	0.45
11	300104	乐视网	54,895,432.42	0.44
12	002292	奥飞动漫	52,086,202.30	0.42
13	300315	掌趣科技	46,215,797.78	0.37
14	002008	大族激光	44,908,094.71	0.36
15	000858	五 粮 液	42,678,260.22	0.34
16	000002	万 科A	41,937,177.33	0.33
17	000559	万向钱潮	39,986,173.70	0.32
18	002241	歌尔声学	38,154,752.43	0.30
19	300027	华谊兄弟	37,665,956.50	0.30
20	000069	华侨城A	37,100,262.97	0.30

注:“买入金额”是指买入股票成交金额,即成交单价乘以成交数量,相关交易费用不考虑。

7.3.4 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300104	乐视网	115,680,184.94	0.92
2	000002	万 科A	104,910,363.46	0.84
3	000651	格力电器	90,779,709.30	0.72
4	000538	云南白药	84,128,005.90	0.67
5	300024	机器人	68,148,009.34	0.54
6	002008	大族激光	63,316,126.45	0.51
7	002241	歌尔声学	58,033,955.06	0.46
8	000625	长安汽车	56,477,379.96	0.45
9	002051	中工国际	49,608,385.68	0.40
10	000559	万向钱潮	48,764,467.27	0.39
11	000581	威孚高科	47,994,390.47	0.38
12	000001	平安银行	45,548,223.54	0.36
13	300070	碧水源	42,323,210.87	0.34
14	000039	中集集团	40,683,990.98	0.32
15	002594	比亚迪	40,251,949.92	0.32
16	002024	苏宁云商	38,417,406.31	0.31
17	002244	滨江集团	37,502,167.67	0.30
18	000831	五矿稀土	37,367,470.89	0.30
19	000776	广发证券	37,239,880.88	0.30
20	000402	金 融 街	36,487,094.18	0.29

注:“卖出金额”是指卖出股票成交金额,即成交单价乘以成交数量,相关交易费用不考虑。

7.3.5 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

序号	2,110,371,352.54
卖出股票收入(成交)总额	2,492,340,236.93

注:表中“买入股票成本(成交)总额”及“卖出股票收入(成交)总额”均指成交金额,即成交单价乘以成交数量,相关交易费用不考虑。

7.4 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	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

7.5 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

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	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

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.3 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