

融通深证成份指数证券投资基金

2014 半年度报告摘要

流动性将逐渐得到改善,可见,政策目前仍明显维持着“优化结构,托底经济”的两头抓的政策思路,经济出现大幅下跌的可能性较小,因而总体来看无需对A股市场过度悲观。从板块看,经过1年多的结构分化后,当前传统产业面临的悲观预期以及新兴产业的乐观预期都体现的较为充分,在政策逐渐微调更加偏向于稳增长、防风险的背景下,传统经济将得到较强的支撑,因而结构分化的特征一定程度上将会变得较为缓和,同时,新兴产业板块经过1年的持续上涨后,整体估值已经较高,新兴产业内部也将出现分化,因而,传统板块和新兴产业都将存在机会。具体来看,传统蓝筹股在“稳增长”政策的支撑下会阶段性出现价值回归和反弹的机会;而在稳增长的前提下,改革则将再起步;资源要素价格改革、国企改革、教育、医药卫生、文化、电力、油气、盐业改革将加快推进,在经济转型期,摆脱旧经济的束缚,实现新旧产业融合,金融实体经济以及混合所有制建设有望成为新的增长点;另一方面,由于“优化结构”仍是政策的主导方向,中国经济要由要素驱动转向创新驱动,产业结构将由重工业为主升级为高端制造业和现代服务业为主,3D打印,新能源、互联网金融和高端装备制造等仍然具有较大的增长空间。

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、登记清算部、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,通过参考行业协会估值意见、参考独立第三方机构估值数据等多种方式有效结合,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,风险管理部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,每日对基金估值品种的公开信息、基金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,截至本报告期末,本外部估值定价服务机构均亦不存在任何重大利益冲突。

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-0.3803元,依据基金合同的约定,本报告期末进行利润分配。

5 托管人报告
5.1 报告期内本基金托管人遵守信情况声明
报告期内,本基金托管人在对融通深证成份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守信、净值计算、利润分配等情况的说明
报告期内,融通深证成份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成份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,融通深证成份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成份指数证券投资基金2014年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、投资组合等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

6.1 资产负债表
会计主体:融通深证成份指数证券投资基金
报告截止日:2014年6月30日
单位:人民币元
资产: 2014年6月30日 2013年12月31日
银行存款 27,270,212.83 36,761,608.75
结算备付金 0.00 0.00
存出保证金 32,152.63 28,896.84
其他各项金融资产 488,776,310.69 579,942,763.63
应收利息 688,776,310.69 878,942,763.63
其他资产 0.00 0.00
资产总计 917,017,111.15 1,675,656,936.85
负债: 2014年6月30日 2013年12月31日
应付赎回款 817,299.39 581,218.00
应付管理人报酬 431,352.97 541,329.43
应付销售服务费 86,276.37 109,260.98
其他负债 20,316.18 39,192.92
负债合计 1,375,244.91 1,371,901.33
所有者权益 781,772.24 303,755.52
所有者权益合计 781,772.24 303,755.52
负债和所有者权益总计 917,017,111.15 1,675,656,936.85

6.2 利润表
会计主体:融通深证成份指数证券投资基金
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 2014年1月1日至2014年6月30日 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入 -49,738,432.26 -103,010,205.05
1.利息收入 112,784.91 168,273.15
其中:存款利息收入 112,784.91 168,273.15
2.公允价值变动收益 -49,851,217.17 -103,178,478.20
其中:交易性金融资产公允价值变动收益 -49,851,217.17 -103,178,478.20
3.其他收入 15,268.44 66,653.70
二、费用 4,107,579.46 6,114,242.54
1.销售服务费 118,820.28 171,562.41
2.管理费用 3,988,759.18 5,942,680.13
三、利润总额 -51,645,851.72 -109,146,452.55
四、净利润 -51,645,851.72 -109,146,452.55

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:融通深证成份指数证券投资基金
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 2014年1月1日至2014年6月30日 2013年1月1日至2013年6月30日
一、基金份额总额 917,536,775.81 1,688,941,553.41
二、本期申购 917,536,775.81 1,688,941,553.41
三、本期赎回 -917,536,775.81 -1,688,941,553.41
四、本期转入 0.00 0.00
五、本期转出 0.00 0.00
六、本期份额变动 0.00 0.00
七、期末基金份额总额 917,536,775.81 1,688,941,553.41

6.4 费用明细
项目 2014年1月1日至2014年6月30日 2013年1月1日至2013年6月30日
一、销售服务费 118,820.28 171,562.41
二、管理费用 3,988,759.18 5,942,680.13
三、其他费用 15,268.44 66,653.70
四、合计 4,107,579.46 6,114,242.54

6.5 其他重要事项
6.5.1 关联方关系
6.5.2 关联交易
6.5.3 关联方往来余额
6.5.4 关联方交易
6.5.5 关联方交易定价政策

6.6 或有事项
6.6.1 资产负债表日存在的或有事项
6.6.2 或有事项对财务状况和经营成果的影响

6.7 承诺事项
6.7.1 资产负债表日存在的承诺事项
6.7.2 承诺事项对财务状况和经营成果的影响

6.8 资产负债表日后事项
6.8.1 资产负债表日后事项对财务状况和经营成果的影响

6.9 其他重要事项
6.9.1 其他重要事项对财务状况和经营成果的影响

6.10 其他重要事项
6.10.1 其他重要事项对财务状况和经营成果的影响

6.11 其他重要事项
6.11.1 其他重要事项对财务状况和经营成果的影响

6.12 其他重要事项
6.12.1 其他重要事项对财务状况和经营成果的影响

6.13 其他重要事项
6.13.1 其他重要事项对财务状况和经营成果的影响

6.14 其他重要事项
6.14.1 其他重要事项对财务状况和经营成果的影响

6.15 其他重要事项
6.15.1 其他重要事项对财务状况和经营成果的影响

6.16 其他重要事项
6.16.1 其他重要事项对财务状况和经营成果的影响

6.17 其他重要事项
6.17.1 其他重要事项对财务状况和经营成果的影响

6.18 其他重要事项
6.18.1 其他重要事项对财务状况和经营成果的影响

6.19 其他重要事项
6.19.1 其他重要事项对财务状况和经营成果的影响

6.20 其他重要事项
6.20.1 其他重要事项对财务状况和经营成果的影响

6.21 其他重要事项
6.21.1 其他重要事项对财务状况和经营成果的影响

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

重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构不存在虚假记载、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深证成份指数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,也不保证基金份额持有人资产不受损失。基金的风险由投资者自行承担,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。本报告中期资料未经审计。本报告自2014年1月1日起至6月30日止。

基金简介
2.1 基金基本情况
基金名称:融通深证成份指数证券投资基金
基金代码:161612
基金管理人:融通基金管理有限公司

2.2 基金产品说明
投资目标:本基金采取完全复制的方式进行被动化投资,通过严格的投资纪律和数量化风险控制手段,力求使本基金净值增长率与业绩比较基准之间的年度偏离度控制在3.5%以内,年化跟踪误差控制在4%以内,以实现对中国深证成份指数的长期增值。
投资策略:本基金为被动式复制指数基金,跟踪上采用完全复制的投资策略,按照成份股在标的指数中的基准权重构建投资组合,并根据标的指数及其权重成份股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年度跟踪误差控制在3.5%以内,年化跟踪误差控制在4%以内。

2.3 基金管理人和基金托管人
名称: 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
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

2.4 信息披露方式
基金年度报告刊登在指定信息披露网站
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 主要会计数据和财务指标
3.1 主要会计数据和财务指标
单位:人民币元

Table with 2 columns: 指标名称, 报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)
1.1 本期利润总额 -42,641,292.48
1.2 本期净利润 -51,645,851.72
1.3 本期基金份额净值增长率 -4.55%

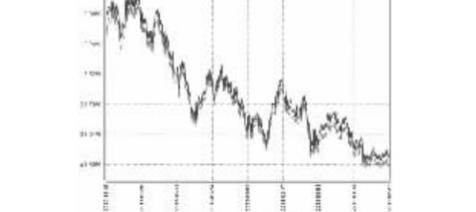
注:(1) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;
(2) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

(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

Table with 5 columns: 阶段, 基金份额净值增长率①, 业绩比较基准收益率②, 差额①-②, 跟踪误差③
过去一个月 0.16% 0.82% -0.27% 0.60% 0.43% -0.13%
过去三个月 3.16% 0.84% 2.08% 0.80% 1.11% -0.25%

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,公司注册资产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、融通丰利四分之法(ODII-FOF)基金、融通七天理财货币基金、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

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期
姓名: 王理强
职务: 基金经理
任职日期: 2009年11月15日
离任日期: -

注:任任何日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、《融通深证成份指数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,在严格控制投资风险的基础上,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。

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 报告期内本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
本基金为被动式复制指数基金,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误差小于0.35%,年化跟踪误差控制在4%的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现
2014年上半年融通深证成份指数基金下跌8.55%,同期业绩比较基准下跌9.09%。沪深300下跌7.08%,从各行业指数的表现来看:电子(申万)、休闲服务(电子)和轻工制造(申万)领涨,分别上涨10.81%、10.44%和9.93%,而采用(申万)和农林牧渔(申万)领跌,分别下跌11.2%和10.06%。

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
今年以来,在断断续续的量化刺激政策下,经济虽时有改善,但持续性较差,且微观企业数据依然脆弱,显示经济反弹基础并不牢固。在此情况下,货币政策依旧从紧的概率不大,而5月30日的国务院会议发布了一系列“定向降准”政策,也预示着货币政策趋于转向宽松,同时,金融市场利率也回落趋稳,市场的

7.4.2 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

Table with 5 columns: 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 000002 万科A 4,413,739.00 1.94
2 000425 华天电子 3,272,927.93 1.50
3 000651 格力电器 3,116,522.70 1.42

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

7.4.3 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

Table with 2 columns: 买入股票成本(成交总额), 卖出股票收入(成交总额)
买入股票成本(成交总额) 80,824,010.01
卖出股票收入(成交总额) 80,125,031.21

注:“买入股票成本(成交总额)”和“卖出股票收入(成交总额)”均按成交单乘以成交数量计算,并能为本基金提供全面的信息服务。

7.5 期末按债券品种和分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
7.11.1 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。

7.11.2 本基金投资国债期货的投资政策
本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注
7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成
单位:人民币元

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额
1 存出保证金 32,152.63
2 应收证券清算款 5,017,314.11
3 应收股利 4,676.81
4 应收利息 22,474.91
5 其他应收款 0.00
6 其他流动资产 0.00
7 其他资产 0.00
8 合计 9,170,171.15

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
7.12.5.2 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。

8 基金份额持有人信息
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构
份额单位:份

Table with 3 columns: 序号, 户均持有的基金份额, 持有人结构
序号: 1
户均持有的基金份额: 19,668
持有人结构: 机构投资者 42,955.54 (4.36%), 个人投资者 970,777.27 (95.64%)

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况
单位:份

Table with 2 columns: 项目, 持有基金份额的数量
项目: 基金合同生效以来(2009年11月15日)基金管理人
持有基金份额的数量: 1,788,708.42 (0.2117%)

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金总量区间的情况
单位:份

Table with 2 columns: 项目, 持有基金份额总量的数量区间(万份)
项目: 基金合同生效以来(2009年11月15日)基金管理人
持有基金份额总量的数量区间(万份): 0-10

9 开放式基金份额变动
单位:份

Table with 2 columns: 基金合同生效以来(2009年11月15日)基金份额变动, 基金份额变动
基金合同生效以来(2009年11月15日)基金份额变动: 1,688,941,553.41
基金份额变动: 917,536,775.81

10 重大事件揭示
10.4 基金份额持有人大会决议
报告期内,本基金未召开基金份额持有人大会。

10.5 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动
10.2.1 基金管理人的重大人事变动
报告期内,基金管理人无重大人事变更。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动
报告期内,因中国工商银行工作需要,周月秋同志不再担任中国工商银行资产托管部总经理,在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续后,由副总经理王立波同志代为行使中国工商银行资产托管部总经理部分业务授权职责。

10.6 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
报告期内,无涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

10.7 基金投资策略的改变
报告期内,本基金投资策略未发生改变。

10.8 为基金进行审计的会计师事务所情况
本基金聘请的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙),该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。

10.9 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
报告期内,本基金的基金管理人、托管人的托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.10 基金租用证券公司交易单元的有关情况
10.10.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况
金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 券商名称, 交易单元数量, 成交金额, 占当期股票成交金额比例, 佣金, 占当期佣金比例, 备注
券商名称: 招商证券
交易单元数量: 1
成交金额: 55,746,364.26
占当期股票成交金额比例: 42.64%
佣金: 49,330.31
占当期佣金比例: 42.65%

注:1.本基金选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的标准包括以下六个方面:
(1)资质雄厚,信誉良好,注册资本不少于3亿元人民币;
(2)财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定;
(3)经营行为规范,最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行的处罚;
(4)内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求;
(5)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服务。

融通基金管理有限公司 二〇一四年八月二十六日