

融通深证100指数证券投资基金

2012 第三季度报告

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:2012年10月24日

重要提示 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... 基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理... 基金的投资业绩并不代表其未来表现...

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:2012年10月24日

Table with 2 columns: 基金简称 (融通深证100指数), 基金代码 (161604), 交易代码 (161604), 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 (15,159,471,902.99份), 投资目标 (运用指数化投资方式...), 投资策略 (以非债券资产90%以上的资产...), 业绩比较基准 (沪深300指数收益率x75%+中债国债综合指数收益率x25%), 风险收益特征 (本基金为股票型基金...), 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)

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期 (2012年7月1日 - 2012年9月30日), 单位:人民币元. Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金资产净值, 5.期末基金份额净值.

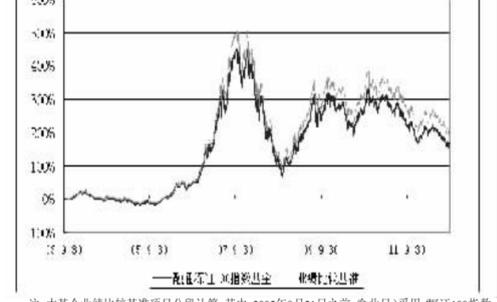
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额... 2.本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用...

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

Table with 5 columns: 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, 业绩比较基准标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月.

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x75%+银行间债券综合指数x25%”,2005年8月22日使用新基准即“深证100指数收益率x75%+银行间债券综合指数收益率x25%”。

4.1 基金经理简介

Table with 4 columns: 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. Rows include 王健强.

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 管理人报告期内本基金运作遵守信情况的说明

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100指数证券投资基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理... 基金的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... 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... 本季度深证100指数跌幅较大,下跌,各行业类指数的表现来看,房地产、汽车、交通运输、机械等行业指数跌幅超过10%;而传媒、医药、食品饮料等行业指数下跌了3%。

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-8.38%,同期业绩比较基准收益率为-7.83%。

5 投资组合报告

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:2012年10月24日

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include 1.权益投资, 2.固定收益投资, 3.金融资产投资, 4.买入返售金融资产, 5.银行存款和结算备付金合计, 6.其他资产, 7.合计.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include A.农林牧渔业, B.采掘业, C.制造业, C01.食品、饮料, C02.纺织、服装、皮毛, C2.木材、家具, C3.造纸、印刷, C4.石油、化学、塑胶、塑料, C5.电子, C6.金属、非金属, C7.机械、设备、仪表, C8.医药、生物制品, C9.其他制造业, D.电力、煤气及水的生产和供应业, E.建筑业, F.交通运输、仓储业, G.信息技术业, H.批发和零售贸易, I.金融、保险业, J.房地产业, K.社会服务业, L.传播与文化业, M.综合类, 合计.

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

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 1. 000002 万科A, 2. 000688 华鲁恒升, 3. 000651 格力电器, 4. 000157 中联重科, 5. 000001 平安银行, 6. 002034 苏泊尔, 7. 002568 泸州老窖, 8. 000776 广发证券, 10. 000423 华谊兄弟.

5.4 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权证投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1. 120228 12国开28, 2. 1101088 11央行票据88, 3. 1101096 11央行票据96, 4. 1101088 11央行票据88, 5. 1101096 11央行票据96.

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

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 1. 120228 12国开28, 2. 1101088 11央行票据88, 3. 1101096 11央行票据96, 4. 1101088 11央行票据88, 5. 1101096 11央行票据96.

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

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 1. 120228 12国开28, 2. 1101088 11央行票据88, 3. 1101096 11央行票据96, 4. 1101088 11央行票据88, 5. 1101096 11央行票据96.

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权证投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1. 120228 12国开28, 2. 1101088 11央行票据88, 3. 1101096 11央行票据96, 4. 1101088 11央行票据88, 5. 1101096 11央行票据96.

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。 5.8.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。 5.8.3 其他资产构成

6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 本报告期初基金份额总额, 本报告期末基金份额总额. Rows include 14,795,458,999.65 and 15,159,471,902.99.

7 备查文件目录

- 7.1 备查文件目录 (一)中国证监会批准融通深证100指数证券投资基金设立的文件 (二)融通深证100指数证券投资基金基金合同 (三)融通深证100指数证券投资基金托管协议 (四)融通深证100指数证券投资基金招募说明书及其更新 (五)融通深证100指数证券投资基金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

7.2 存放地点 基金管理人、基金托管人处 7.3 查阅方式 投资者可在营业时间内免费查阅,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 二〇一二年十月二十四日

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 报告送出日期:2012年10月24日

重要提示 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... 基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理... 基金的投资业绩并不代表其未来表现...

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:2012年10月24日

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期 (2012年7月1日 - 2012年9月30日), 单位:人民币元. Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金资产净值, 5.期末基金份额净值.

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... 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...

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

Table with 5 columns: 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, 业绩比较基准标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月.

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日之前(含此日)之前采用“沪深300指数x75%+银行间债券综合指数x25%”,2010年1月1日起使用新基准即“沪深300指数收益率x75%+中债国债综合指数收益率x25%”。

4.1 基金经理简介

Table with 4 columns: 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. Rows include 严非.

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 管理人报告期内本基金运作遵守信情况的说明

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100指数证券投资基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理... 基金的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... 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

本季度市场继续下跌,沪深300指数跌幅6.85%,中小板综指和创业板综指跌幅分别为5.93%和5.99%。本季度医药行业数据继续走弱,国内缺乏有力度的政策刺激,经济悲观预期增强,大部分企业盈利预期被下调,而前期强势的房地产板块,由于销售转暖,调控预期再度出现,虽然月份内外部都出现了一定的利好因素,但发改委连续审批项目,美国推出QE3,欧债危机持续发酵,但市场反应较弱。本季度纺织服装、机械、汽车、房地产、电力设备、轻工制造、商贸零售、国防军工等领域,报告期末本基金的投资策略是适当降低仓位,控制市场风险,由于持有的金融、房地产在三季度出现较大跌幅,对基金净值产生了拖累。

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-5.11%,同期业绩比较基准收益率为-5.07%。

5 投资组合报告

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:2012年10月24日

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include 1.权益投资, 2.固定收益投资, 3.金融资产投资, 4.买入返售金融资产, 5.银行存款和结算备付金合计, 6.其他资产, 7.合计.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include A.农林牧渔业, B.采掘业, C.制造业, C01.食品、饮料, C02.纺织、服装、皮毛, C2.木材、家具, C3.造纸、印刷, C4.石油、化学、塑胶、塑料, C5.电子, C6.金属、非金属, C7.机械、设备、仪表, C8.医药、生物制品, C9.其他制造业, D.电力、煤气及水的生产和供应业, E.建筑业, F.交通运输、仓储业, G.信息技术业, H.批发和零售贸易, I.金融、保险业, J.房地产业, K.社会服务业, L.传播与文化业, M.综合类, 合计.

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

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 1. 603118 中国平安, 2. 000002 万科A, 3. 600048 保利地产, 4. 601628 中国人寿, 5. 000562 宏都证券, 6. 600030 中信证券, 7. 600085 同德股份, 8. 601918 国投新集, 9. 601288 农业银行, 10. 000204 苏宁电器.

5.4 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权证投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1. 120228 12国开28, 2. 1101088 11央行票据88, 3. 1101096 11央行票据96, 4. 1101088 11央行票据88, 5. 1101096 11央行票据96.

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

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 1. 120228 12国开28, 2. 1101088 11央行票据88, 3. 1101096 11央行票据96, 4. 1101088 11央行票据88, 5. 1101096 11央行票据96.

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

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 1. 120228 12国开28, 2. 1101088 11央行票据88, 3. 1101096 11央行票据96, 4. 1101088 11央行票据88, 5. 1101096 11央行票据96.

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权证投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1. 120228 12国开28, 2. 1101088 11央行票据88, 3. 1101096 11央行票据96, 4. 1101088 11央行票据88, 5. 1101096 11央行票据96.

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。 5.8.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。 5.8.3 其他资产构成

6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 本报告期初基金份额总额, 本报告期末基金份额总额. Rows include 1,733,403,592.91 and 1,733,403,592.91.

7 备查文件目录

- 7.1 备查文件目录 (一)中国证监会批准融通深证100指数证券投资基金设立的文件 (二)融通深证100指数证券投资基金基金合同 (三)融通深证100指数证券投资基金托管协议 (四)融通深证100指数证券投资基金招募说明书及其更新 (五)融通深证100指数证券投资基金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

7.2 存放地点 基金管理人、基金托管人处 7.3 查阅方式 投资者可在营业时间内免费查阅,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 二〇一二年十月二十四日

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 报告送出日期:2012年10月24日

重要提示 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... 基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理... 基金的投资业绩并不代表其未来表现...

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:2012年10月24日

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期 (2012年7月1日 - 2012年9月30日), 单位:人民币元. Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金资产净值, 5.期末基金份额净值.

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... 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...

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

Table with 5 columns: 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, 业绩比较基准标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月.

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日之前(含此日)之前采用“沪深300指数x75%+银行间债券综合指数x25%”,2010年1月1日起使用新基准即“沪深300指数收益率x75%+中债国债综合指数收益率x25%”。

4.1 基金经理简介

Table with 4 columns: 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. Rows include 严非.

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 管理人报告期内本基金运作遵守信情况的说明

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100指数证券投资基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理... 基金的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... 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

本季度市场继续下跌,沪深300指数跌幅6.85%,中小板综指和创业板综指跌幅分别为5.93%和5.99%。本季度医药行业数据继续走弱,国内缺乏有力度的政策刺激,经济悲观预期增强,大部分企业盈利预期被下调,而前期强势的房地产板块,由于销售转暖,调控预期再度出现,虽然月份内外部都出现了一定的利好因素,但发改委连续审批项目,美国推出QE3,欧债危机持续发酵,但市场反应较弱。本季度纺织服装、机械、汽车、房地产、电力设备、轻工制造、商贸零售、国防军工等领域,报告期末本基金的投资策略是适当降低仓位,控制市场风险,由于持有的金融、房地产在三季度出现较大跌幅,对基金净值产生了拖累。

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-5.11%,同期业绩比较基准收益率为-5.07%。

5 投资组合报告

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:2012年10月24日

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include 1.权益投资, 2.固定收益投资, 3.金融资产投资, 4.买入返售金融资产, 5.银行存款和结算备付金合计, 6.其他资产, 7.合计.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include A.农林牧渔业, B.采掘业, C.制造业, C01.食品、饮料, C02.纺织、服装、皮毛, C2.木材、家具, C3.造纸、印刷, C4.石油、化学、塑胶、塑料, C5.电子, C6.金属、非金属, C7.机械、设备、仪表, C8.医药、生物制品, C9.其他制造业, D.电力、煤气及水的生产和供应业, E.建筑业, F.交通运输、仓储业, G.信息技术业, H.批发和零售贸易, I.金融、保险业, J.房地产业, K.社会服务业, L.传播与文化业, M.综合类, 合计.

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

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 1. 603118 中国平安, 2. 000002 万科A, 3. 600048 保利地产, 4. 601628 中国人寿, 5. 000562 宏都证券, 6. 600030 中信证券, 7. 600085 同德股份, 8. 601918 国投新集, 9. 601288 农业银行, 10. 000204 苏宁电器.

5.4 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权证投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1. 120228 12国开28, 2. 1101088 11央行票据88, 3. 1101096 11央行票据96, 4. 1101088 11央行票据88, 5. 1101096 11央行票据96.

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

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 1. 120228 12国开28, 2. 1101088 11央行票据88, 3. 1101096 11央行票据96, 4. 1101088 11央行票据88, 5. 1101096 11央行票据96.

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

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 1. 120228 12国开28, 2. 1101088 11央行票据88, 3. 1101096 11央行票据96, 4. 1101088 11央行票据88, 5. 1101096 11央行票据96.

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权证投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1. 120228 12国开28, 2. 1101088 11央行票据88, 3. 1101096 11央行票据96, 4. 1101088 11央行票据88, 5. 1101096 11央行票据96.

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。 5.8.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。 5.8.3 其他资产构成

6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 本报告期初基金份额总额, 本报告期末基金份额总额. Rows include 1,733,403,592.91 and 1,733,403,592.91.

7 备查文件目录

- 7.1 备查文件目录 (一)中国证监会批准融通深证100指数证券投资基金设立的文件 (二)融通深证100指数证券投资基金基金合同 (三)融通深证100指数证券投资基金托管协议 (四)融通深证100指数证券投资基金招募说明书及其更新 (五)融通深证100指数证券投资基金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

7.2 存放地点 基金管理人、基金托管人处 7.3 查阅方式 投资者可在营业时间内免费查阅,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 二〇一二年十月二十四日

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 报告送出日期:2012年10月24日

重要提示 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... 基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理... 基金的投资业绩并不代表其未来表现...

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:2012年10月24日

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期 (2012年7月1日 - 2012年9月30日), 单位:人民币元. Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金资产净值, 5.期末基金份额净值.

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