融通深证成份指数证券投资基金

【2012】第四季度报告

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：2013年1月22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2013年1月17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。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通深证成份指数	
基金主代码	161612	
交易代码	161612(前端收费模式)	161662(后端收费模式)
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	1,189,108,813.41份	
投资目标	本基金采取完全复制方法进行指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内，以实现对深证成份指数的有效跟踪。	
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，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控制在0.35%以内、年化跟踪误差控制在4%的投资目标。	
业绩比较基准	深证成份指数收益率×95% + 银行活期存款利率×5%	
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，属于高风险高收益的基金品种，其收益和风险均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。	
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

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2012年10月1日－2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-56,951,488.30
2.本期利润	46,138,460.23
3.加权平均基金份额本期利润	0.0373
4.期末基金资产净值	896,127,097.24
5.期末基金份额净值	0.754

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损益。

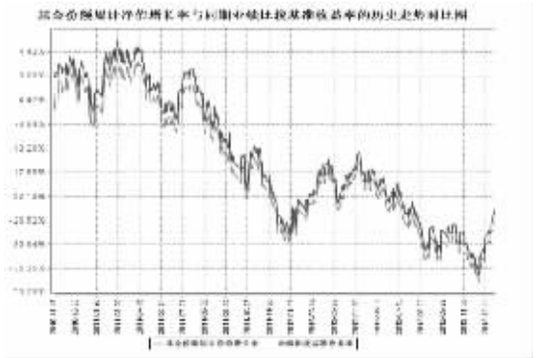
②本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	5.31%	1.30%	4.81%	1.26%	0.50%	0.04%

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



§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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王建强	本基金基金经理、融通深证100指数基金基金经理、融通巨潮100指数基金(LOF)基金经理、融通创业板指数基金基金经理	2010年11月15日	-	9	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。
李勇	本基金的基金经理、融通创业板指数基金基金经理	2010年11月15日	-	8	研究生学历，具有证券从业资格。2005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》、融通深证成份指数证券投资基金基金基金合同》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 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金本报告期内基金份额净值增长率为5.31%，同期业绩比较基准收益率为4.81%。沪深300上涨10.02%，从各行业类指数的表现来看：房地产（申万）、金融服务（申万）领涨，涨幅达20%左右。

§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	851,122,066.79	91.47
	其中：股票	851,122,066.79	91.47
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	45,872,886.92	4.93
6	其他资产	33,451,433.70	3.60
7	合计	930,446,387.41	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	采掘业	50,907,031.93	5.68
C	制造业	457,042,523.82	51.00
C0	食品、饮料	128,058,557.38	14.29
C1	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	17,146,640.00	1.91
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	81,848,023.84	9.13
C7	机械、设备、仪表	171,843,825.03	19.18
C8	医药、生物制品	58,145,477.57	6.49
C99	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	19,157,326.50	2.14
H	批发和零售贸易	29,861,392.75	3.33
I	金融、保险业	113,910,768.87	12.71
J	房地产业	114,995,680.92	12.83
K	社会服务业	32,529,315.00	3.63
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	818,404,039.79	91.33

5.2.2 报告期末积极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	采掘业	-	-
C	制造业	13,755,936.59	1.54
C0	食品、饮料	-	-
C1	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	13,755,936.59	1.54
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,802,987.54	0.98
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	10,159,102.87	1.13
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	32,718,027.00	3.65

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股票投资明细

5.3.1 报告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

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	8,775,691	93,197,838.42	10.40
2	000651	格力电器	2,354,421	60,037,735.50	6.70
3	000858	五 粮 液	1,888,045	53,299,510.35	5.95
4	000001	平安银行	2,785,891	44,629,973.82	4.98
5	000157	中联重科	4,606,781	42,428,453.01	4.73
6	000069	华侨城A	4,337,242	32,529,315.00	3.63
7	002024	苏宁电器	4,490,435	29,861,392.75	3.33
8	000776	广发证券	1,872,648	28,876,232.16	3.22
9	000568	泸州老窖	734,743	26,009,902.20	2.90
10	000423	东阿阿胶	615,077	24,855,261.57	2.77

5.3.2 报告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

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	000024	招商地产	339,883	10,159,102.87	1.13
2	002081	金 螳 螂	199,977	8,802,987.54	0.98
3	002241	歌尔声学	199,873	7,535,212.10	0.84
4	002415	海康威视	199,959	6,220,724.49	0.69

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名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名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

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本基金合同规定的备选股票库。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	307,514.60
2	应收证券清算款	32,999,889.85
3	应收股利	-
4	应收利息	10,199.13
5	应收申购款	133,830.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	33,451,433.70

5.8.4 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。

5.8.5 报告期末股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000002	万 科A	93,197,838.42	10.40	重大事项停牌

5.8.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	1,236,941,591.38
本报告期基金总申购份额	30,275,190.81
减：本报告期基金总赎回份额	78,107,968.78
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,189,108,813.41

§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

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
二〇一三年一月二十二日

融通新蓝筹证券投资基金

【2012】第四季度报告

基金管理人：融通基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：2013年1月22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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年1月18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。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通新蓝筹混合	
交易代码	161601	
交易代码	161601(前端收费模式)	161602(后端收费模式)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2002年9月13日	
报告期末基金份额总额	14,611,992,343.03份	
投资目标	主要投资于处于成长阶段和成熟阶段早期的“新蓝筹”上市公司。通过组合投资，在充分控制风险的前提下实现基金净值的稳定增长，为基金持有人获取长期稳定的投资收益。	
投资策略	在对市场趋势判断的前提下，重视仓位选择和行业配置，同时更重视基本面分析，强调通过基本面分析挖掘个股。在正常市场状况下，股票投资比例浮动范围：30%-75%；债券投资比例浮动范围：20%-55%；权证投资比例浮动范围：0%-3%；现金留存比例浮动范围：不低于5%。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+中信标普全债指数收益率×25%	
风险收益特征	在适度风险下追求较高收益	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-256,584,495.93
2.本期利润	470,534,493.84
3.加权平均基金份额本期利润	0.0320
4.期末基金资产净值	10,269,560,926.77
5.期末基金份额净值	0.7028

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；

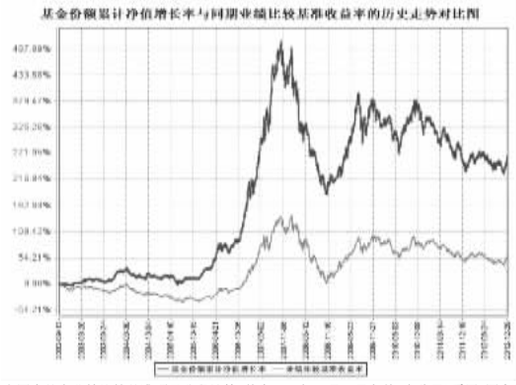
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	4.82%	0.83%	7.80%	0.96%	-2.98%	-0.13%

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：上图中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）采用“国泰君安指数×75%+银行间债券综合指数×25%”，2010年1月1日起使用新基准即“沪深300指数收益率×75%+中信标普全债指数收益率×25%”。

§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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
汪忠远	本基金的基金经理、融通通乾封闭基金的基金经理	2010年4月23日	-	17	毕业于曼彻斯特大学商学院，研究生学历，具有证券从业资格。1993年至1997年，任职君安证券武汉营业部投资经理；1997年至1999年，任职延宁发展有限公司证券投资部经理；2001年至2005年，任职深圳林奇投资顾问有限公司投资经理；2006年加入融通基金管理有限公司，任机构理财部投资经理助理。
吴巍	本基金的基金经理、融通医疗保健行业股票基金的基金经理、基金管理部执行总监	2011年4月6日	-	20	硕士学位，具有证券从业资格。自1993年7月起，先后任职珠海丽珠医药集团公司药品开发工程师、中旅信证券深圳研究所行业研究员、深圳市至善投资有限公司行业研究员、宝盈基金管理有限公司行业研究员，2003年12月进入融通基金管理有限公司，先后任行业研究员、研究部总监、基金管理部总监。
姚昆	本基金的基金经理	2012年7月25日	-	8	经济学硕士，具有证券从业资格。硕士毕业后即加入广发证券股份有限公司，任发展研究中心研究员，从事装备制造业上市公司研究工作。2007年加入融通基金管理有限公司，曾任研究部行业研究员、行业组长、部门总监助理。

注：任职日期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、融通新蓝筹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 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 报告期内基金投资策略和运作分析

2012年四季度，在基建投资和地产销售的带动下，宏观经济企稳。A股由于制度性原因，对宏观经济指标的转好反应滞后，上证指数在12月4日下跌至1949点后，在银行股的带动下开始强劲反弹。

新蓝筹基金在2012年四季度期间，遵循基金契约，坚持“核心周期龙头和优质成长股”的配置思路，同时结合宏观经济企稳所带来的市场预期变化，增加了银行、地产等低估值板块的配置比例，对高估值的成长股进行了进一步的优化，减持了部分景气下行的食品饮料类股票。在新蓝筹的长期持仓中，更加注重筛选具有核心商业模式的优质成长股票。

展望2013年，随着十八大的召开，在新型城镇化和制度红利的释放下，中国将进入一个新的时代。虽然经济结构的转型和其他深层次的矛盾破解需要更高的勇气和智慧，也需要更多的时间和实践，但面向2013年，在新一届政府的带领下，市场在预期之下充满希望。

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4.82%，同期业绩比较基准的收益率为7.80%。组合中贡献较大的是银行、地产和建材。对组合负贡献较大的是白酒、旅游和软件等。

§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	7,506,851,103.47	72.09
	其中：股票	7,506,851,103.47	72.09
2	固定收益投资	2,147,320,515.60	20.62
	其中：债券	2,147,320,515.60	20.62
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	718,882,690.50	6.90
6	其他资产	40,086,572.01	0.38
7	合计	10,413,140,881.58	100.00

5.2 报告期末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	17,202,504.00	0.17
B	采掘业	316,630,000.00	3.08
C	制造业	3,230,912,740.19	31.46
C0	食品、饮料	761,597,362.24	7.42
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	7,500,000.00	0.07
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	468,930,826.52	4.57
C5	电子	250,205,251.75	2.44
C6	金属、非金属	283,094,076.40	2.76
C7	机械、设备、仪表	745,302,813.87	7.26
C8	医药、生物制品	714,282,409.41	6.96
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	78,438,000.00	0.76
E	建筑业	144,775,377.60	1.41
F	交通运输、仓储业	301,870,000.00	2.94
G	信息技术业	62,422,700.00	0.61
H	批发和零售贸易	216,398,540.60	2.11
I	金融、保险业	1,626,616,928.14	15.84
J	房地产业	1,038,011,849.68	10.11
K	社会服务业	429,642,647.26	4.18
L	传播与文化产业	43,929,816.00	0.43
M	综合类	-	-
	合计	7,506,851,103.47	73.10

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	59,991,041	637,104,855.42	6.20
2	000538	云南白药	7,951,529	540,703,972.00	5.27
3	600016	民生银行	55,009,855	432,377,460.30	4.21
4	601166	兴业银行	22,500,888	375,539,820.72	3.66
5	600809	山西汾酒	8,000,784	333,312,661.44	3.25
6	000024	招商地产	10,000,234	298,906,994.26	2.91
7	600221	海南航空	69,000,000	284,970,000.00	2.77
8	600519	贵州茅台	1,100,000	229,922,000.00	2.24
9	601318	中国平安	5,050,880	228,754,355.20	2.23
10	300070	碧水源	5,211,392	208,976,819.20	2.03

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	13,739,515.60	0.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,133,581,000.00	20.78
	其中：政策性金融债	2,133,581,000.00	20.78
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	2,147,320,515.60	20.91

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

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(%)
1	120219	12国开19	3,400,000	340,136,000.00	3.31
2	120320	12进出20	3,100,000	305,133,000.00	2.97
3	120238	12国开38	2,700,000	269,622,000.00	2.63
4	110234	11国开34	2,000,000	200,880,000.00	1.96
5	110257	11国开57	1,500,000	151,065,000.00	1.47

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

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本基金合同规定的备选股票库。

5.8.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,387,370.58
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	36,528,598.26
5	应收申购款	170,603.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	40,086,572.01

5.8.4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。

5.8.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000002	万 科A	637,104,855.42	6.20	重大事项停牌
2	600221	海南航空	284,970,000.00	2.77	非公开发行

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	14,826,751,629.21
本报告期基金总申购份额	16,011,149.58
减：本报告期基金总赎回份额	230,770,435.76
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	14,611,992,343.03

§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新蓝筹证券投资基金设立的文件

（二）融通新蓝筹证券投资基金基金合同》

（三）融通新蓝筹证券投资基金托管协议》

（四）融通新蓝筹证券投资基金招募说明书》及其更新

（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

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http://www.rtfund.com查询。

融通基金管理有限公司
二〇一三年一月二十二日

融通四季添利债券型证券投资基金

【2012】第四季度报告

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：2013年1月22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2013年1月17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。

本报告期自2012年10月1日起至2012年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通四季添利债券
基金主代码	161614
交易代码	161614
基金运作方式	契约型。本基金合同生效后两年内封闭运作，在深圳证券交易所上市交易，基金合同生效满两年后，转为上市开放式基金(LOF)。
基金合同生效日	2012年3月1日
报告期末基金份额总额	1,281,761,462.73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，通过对宏观经济运行状况的研究，积极的调整和优化固定收益类金融工具的资产比例配置。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

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)
1.本期已实现收益	20,991,447.37
2.本期利润	19,307,544.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.0151
4.期末基金资产净值	1,308,217,965.56
5.期末基金份额净值	1.021

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。

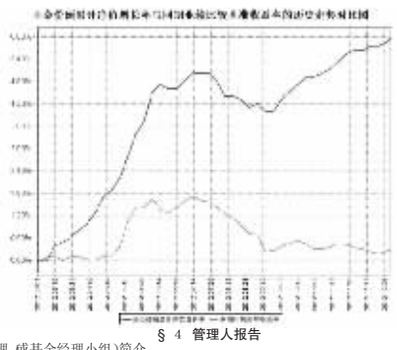
②本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	1.48%	0.07%	-0.13%	0.02%	1.61%	0.05%

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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蔡奕奕	本基金的基金经理、融通易支付货币基金的基金经理、融通岁岁添利定期开放债券基金的基金经理	2012年3月1日	-	7	管理科学硕士，具有证券从业资格。2006年3月至2006年11月，就职于万家基金管理有限公司，担任交易员职务；从事股票债券交易工作；2006年12月至2008年8月，就职于银河基金管理有限公司，担任交易员职务，从事债券交易工作；2008年9月至今，就职于融通基金管理有限公司，历任交易员、行业研究员职务。

注：任职日期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、融通动力先锋股票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 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度宏观环境呈现经济逐步走稳回升、通胀平稳的格局。进入四季度随着政策逐步松绑，基建投资的放开和房地产景气提升，PMI持续回升至50的荣枯线上方，宏观数据显示经济正在逐步的企稳回升中；此外海外经济也保持稳定，令市场风险偏好大幅提升，加之通胀回落至1.7%的低点，信用债券市场在四季度表现良好。随着流动性的逐步改善和风险偏好的提升，四季度信用债市场获得较为可观的持有收益，收益率水平整体较三季度有明显下行。

考虑到三季度债券市场的调整已经较为充分，信用类债券的配置价值已经显现，四季度本基金采取较为积极的配置策略，同时对组合部分持仓进行了置换，进一步完善组合的配置结构，在三季度初即提高了组合杠杆比率，并在年末及时兑现了该部分收益。

在当前时点展望明年的宏观经济环境：经济的弱复苏格局有望持续；受高基数影响，通胀在未来的1-2个季度内尚不足为虑；总体流动性依然维持宽松，因此整体市场风险偏好仍较高，尽管期间会爆发个别信用事件，但是爆发因流动性或经济急速下滑导致的集体信用事件的概率较低，加上当前的信用债整体收益率处于历史1/2分位数以上，因此通过深入的信用分析，信用类债券依然可以获得较好的持有价值。但由于逆回购导致的资金成本较高，信用类债券的下滑收益仍较难获取，总体配置以持有收益为主。

下一阶段本基金仍将密切关注信用类债券的投资机会，通过深入的信用研究，择时提高组合杠杆率水平，同时进一步优化信用债的配置结构，提高持有价值较高资质较优的信用债的配置比例。

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1.48%，同期业绩比较基准收益率为-0.13%。

§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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	1,588,549,900.00	94.54
	其中：债券	1,588,549,900.00	94.54
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-