

# 融通债券投资基金

## [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

融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。本报告为融通利系列证券投资基金之子基金融通债券投资基金(以下简称“本基金”)2012年第4季度报告。

基金管理人的董事会及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责任。

基金管理人和中国工商银行股份有限公司根据《融通利系列证券投资基金基金合同》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。

本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 融通债券

基金主代码 161603

基金运作方式 约定期开放式

基金合同生效日 2003年9月30日

报告期末基金份额总额 715,948,890.34份

投资目标 在强调资金安全的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。

投资策略 以组合化为基本策略,利用收益曲线模型和债券品种定价模型,选取较为稳定的收益,捕捉市场出现的中短期投资机会。

## §3 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)

融通债券A/B类 融通债券C类

1.本期已实现收益 2,224,671.23 5,024,833.12

2.本期利润 2,623,050.94 6,813,225.85

3.加权平均基金份额本期利润 0.0114 0.0113

4.期末基金份额净值 249,978,384.33 484,125,792.17

5.期末基金份额净值 1.028 1.026

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.本报告所列示的基本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将低于所列数字。

## 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

1. 融通债券A/B类

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 单准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.06% 0.05% 1.02% 0.02% 0.04% 0.03%

2. 融通债券C类

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 单准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.06% 0.05% 1.02% 0.02% 0.04% 0.03%

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

1. 融通债券A类

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 单准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.06% 0.05% 1.02% 0.02% 0.04% 0.03%

2. 融通债券C类

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 单准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.06% 0.05% 1.02% 0.02% 0.04% 0.03%

注:本基金业绩比较基准项目分段计算,其中:2009年12月31日(含此日)之前采用“银行间债券综合指数”,2010年1月1日起使用新基准即“中信标普全债指数收益率”。

2. 融通债券C类

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 单准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.06% 0.05% 1.02% 0.02% 0.04% 0.03%

5.4 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。

5.5 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权证投资明细

本基金不进行主动权证投资,本报告期末未持有因投资可分离转债而获得的权证。

5.6 投资组合报告附注

5.6.1 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。

5.6.2 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 250,000.00

2 应收证券清算款

3 应收股利

4 应收利息 17,396,362.73

5 应收申购款 4,881,669.13

6 其他应收款

7 待摊费用

8 其他

9 合计 22,528,031.86

5.6.3 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。

5.6.4 开放式基金份额变动

单位:份

项目 融通债券A/B类 融通债券C类

本报告期期初基金份额总额 213,639,585.38 572,373,506.04

本报告期基金份额申购 162,851,431.28 419,586,447.49

减:本报告期基金份额赎回 133,372,809.33 520,029,270.52

本报告期基金份额申购 0 -

本报告期期末基金份额总额 243,118,207.33 471,930,683.01

5.7 备查文件目录

7.1 各备查文件目录

(一)中国证监会批准融通利系列证券投资基金设立的文件

(二)融通利系列证券投资基金基金合同

(三)融通利系列证券投资基金基金托管协议

(四)融通利系列证券投资基金招募说明书及其更新

5.8 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

5.9 报告期内,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。

本基金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。

5.10 基金产品概况

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)

融通债券A/B类 融通债券C类

1.本期已实现收益 2,224,671.23 5,024,833.12

2.本期利润 2,623,050.94 6,813,225.85

3.加权平均基金份额本期利润 0.0114 0.0113

4.期末基金份额净值 249,978,384.33 484,125,792.17

5.期末基金份额净值 1.028 1.026

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.本报告所列示的基本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将低于所列数字。

## 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(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 单准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 5.91% 0.85% 7.80% 0.96% -1.89% -0.11%

5.11 基金经理简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

张李陵 本基金管理人 2012年8月29日 7 清华大学经济学硕士,理学学士,具有证券从业资格,2006年7月至2012年7月在招商银行总行工作,主要从事债券投资和交易。2012年7月加入融通基金管理有限公司。

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,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。

本基金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。

5.12 基金产品概况

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)

融通债券A/B类 融通债券C类

1.本期已实现收益 -27,390,054.34

2.本期利润 94,229,582.33

3.加权平均基金份额本期利润 0.0561

4.期末基金份额净值 1,687,280,913.22

5.期末基金份额净值 1.003

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.本报告所列示的基本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将低于所列数字。

## 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(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 单准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 5.91% 0.85% 7.80% 0.96% -1.89% -0.11%

5.13 基金经理简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

严非 本基金管理人 2007年3月2日 10 经济学硕士,具有证券从业资格,先后就职于国泰君安证券有限公司、红塔证券从事证券投资研究工作。2006年7月加入融通基金管理有限公司任行业研究员。

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,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。

本基金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。

5.14 基金产品概况

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)