

融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)

2014 年度 报告 摘要

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，相关交易费用不计考虑。
8.4.3 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		
买入股票成本(成交)总额		919,916,795.94
卖出股票收入(成交)总额		1,113,114,166.42

注：“买入股票成本(成交)总额”和“卖出股票收入(成交)总额”均按成交单价乘以成交量数填列，相关交易费用不计考虑。
8.5 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	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	70,111,000.00	3.02
3.1	其中：政策性金融债	70,111,000.00	3.02
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	70,111,000.00	3.02

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	140207	14国开07	400,000	40,060,000.00	1.73
2	140430	14农发30	300,000	30,050,000.00	1.30

8.7 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。
8.8 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。
8.9 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。
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
8.10.1 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。
8.10.2 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。
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
8.11.1 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。
8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。
8.11.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未投资国债期货。
8.12 投资组合报告附注
8.12.1
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。
8.12.2
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。
8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

8.12.4 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。
8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。
8.12.5.2 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

序号	名称	金额
1	存在保证金	151,263.78
2	应收证券清算款	5,143,854.06
3	应收股利	-
4	应收利息	2,243,443.86
5	应收申购款	3,741,096.33
6	预收账款	-
7	其他	-
9	合计	11,461,660.03

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市份额比例
1	恒凡	1,716,217.00	4.00%
2	曾进宇	825,000.00	1.92%
3	宋进宇	483,500.00	1.13%
4	杜磊	421,300.00	0.98%
5	方燕秋	336,870.00	0.78%
6	千阳虹	300,000.00	0.70%
7	雷虹	260,000.00	0.61%
8	翁景欣	240,500.00	0.56%
9	宗崇基	240,300.00	0.56%
10	陈慧红	223,001.00	0.52%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	524,494.99	0.0254%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人员持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

基金合同生效日(2005年5月12日)	基金份额总额	基金份额净值
	313,527,198.43	2,362,380.635
本报告期基金份额总额	328,087,144.45	
期末基金份额总额	649,175,544.84	
本报告期基金份额总额	2,061,299,632.26	

重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议
本基金本报告期未召开基金份额持有人大会。
10.2 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
1、基金管理人重大人事变动
1.1 经公司董事会审议并经中国证监会核准，孟朝霞女士担任公司总经理职务，吴星华先生不再担任公司总经理职务。
具体内容请参阅2014年9月25日在《证券时报》上刊登的相关公告。
2. 经公司董事会审议通过并报中国证监会基金业协会和中国证券投资基金业协会深圳监管局备案，秦玮先生不再担任公司副总经理职务。
具体内容请参阅2014年12月31日在《证券时报》上刊登的相关公告。
3. 基金托管人的专门基金托管部门/的重大人事变动
本报告期间内，因中国工商银行股份有限公司(以下简称“本行”)工作需要，周月秋同志不再担任本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“本行”工作交接后，立即辞去本行资产托管部总经理职务，由副经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。
10.3 涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼
10.4 基金管理人、基金资产、基金托管业务在本报告期内无诉讼事项。
10.5 基金投资策略的改变
本基金投资策略在本报告期内未发生变更。
10.6 基金聘请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)，该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今，本年度应支付的审计费用为96,000.00元。
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况
10.7.1 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

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	占当期佣金总额比例	备注
新時代證券	1	960,139,527.84	47.23%	874,110.42	47.48%	-
光大證券	1	746,698,232.18	36.73%	678,236.06	36.84%	-
銀華證券	1	326,193,204.34	16.04%	288,448.78	15.68%	-
中山證券	2	-	-	-	-	-
民生證券	2	-	-	-	-	-
廣州證券	2	-	-	-	-	-
民生證券	1	-	-	-	-	-
東江證券	1	-	-	-	-	-

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。
2、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四个步骤：
(1) 券商服务评价；
(2) 拟定相对评价，由研究部根据以上评价结果拟定备选券商；
(3) 上报批准。研究部将拟定相对评价对象上报分管副总经理批准；
(4) 签约。在获得批准后，按公司签约程序代表公司与确定券商签约。
3、交易单元变更情况
本期终止广发证券1个交易单元。
10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况
本基金本报告期无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

融通基金管理有限公司
二〇一五年三月二十六日

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
送出日期：2015年3月26日

§ 1 重要提示
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法律责任。 本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)基金合同规定，于2014年3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，保证复验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。投资者有风险，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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。
本报告中的财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2014年1月1日起至12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	融通巨潮100指数(LOF)
场内简称	融通巨潮
基金代码	161607
场内简称代码	161607
前次交易日期	161607
基金运作方式	契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2005年5月12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	2,061,299,632.26
基金合同存续期	不定期
基金上市证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2005—06—16

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型指数基金。在控制投资组合跟踪误差的前提下，力求获得超越巨潮100指数的投资收益。追求长期的资本增值。本基金谋求分享中国经济的持续、稳定增长和中国证券市场发展的成果，实现基金资产的长期增值，为投资者谋求稳定的回报。
投资策略	本基金以数量化分析作为主要投资策略，在此基础上进行适度的主动调整。在数量化投资方法与基金管理人研究分析相结合的基础上，本基金投资组合包括股票、债券、货币市场工具、权证、股指期货和国债期货等。本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例不低于85%。
业绩比较基准	巨潮100指数收益率×95%+银行间同业拆放利率×5%。
风险收益特征	风险和预期收益率接近沪深300平均水平。

2.3 基金管理人及基金托管人

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
办公地址	深圳市福田区	深圳市
信息披露负责人	陈建	陈建
联系电话	(0755)3048866	(010)66108799
电子邮箱	service@fund.ritund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务热线	400-883-8888、(0755)26948888	95588
传真	(0755)3305505	(010)66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的基金管理人互联网网址	www.ritund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人、深圳证券交易所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

	2014年	2013年	2012年
3.1.1 期间数据和指标			
本期已实现收益	-30,866,040.69	-216,403,350.11	-219,596,169.17
本期利润	810,661,796.91	-202,015,851.71	229,902,677.66
加权平均基金份额本期利润	0.3667	-0.0796	0.0839
期末基金份额净值增长率	56.76%	-10.15%	11.45%

	2014年末	2013年末	2012年末
3.1.2 期末数据和指标			
期末基金份额净值	0.4554	0.4253	-0.3262
期末基金资产净值	2,317,847,796.28	1,708,956,753.88	2,134,580,968.86
期末基金份额净值	1.124	0.727	0.798

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	业绩比较基准收益率	①-②	②-③
过去三个月	51.08%	1.52%	49.56%	1.44%
过去六个月	67.01%	1.43%	65.58%	3.68%
过去一年	56.76%	1.26%	55.50%	4.01%
过去三年	56.98%	1.28%	55.70%	4.70%
过去五年	1.87%	1.32%	0.55%	0.01%
自基金合同生效起至今	274.36%	1.72%	272.64%	-22.51%

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



注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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

注：本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