

融通通利系列证券投资基金之 融通深证100指数证券投资基金

2014 年 度 报 告 摘 要

注：“买入金额”是指买入股票成交金额,即成交单价乘以成交量,相关交易费用不考虑。
8.4.2 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				占期初基金资产净值比例(%)
序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	
1	000002	万科A	272,232,262.62	2.17
2	000061	格力电器	237,229,037.62	1.86
3	300104	乐视网	146,102,060.80	1.19
4	000001	平安银行	141,102,042.20	1.13
5	002241	歌尔声学	141,444,724.62	1.13
6	000538	云南铜业	141,360,101.40	1.13
7	000776	广发证券	135,240,122.90	1.08
8	300024	机器人	125,124,900.00	1.00
9	000039	中集集团	120,719,919.97	0.96
10	002230	科大讯飞	114,638,585.03	0.91
11	000333	美的集团	107,300,806.10	0.86
12	000024	苏宁云商	106,506,696.46	0.85
13	000626	长安汽车	105,489,456.23	0.84
14	000793	长江证券	104,585,133.61	0.83
15	000049	华鲁恒升	101,798,941.49	0.81
16	000868	东方集团	96,862,605.17	0.77
17	002143	爱康医疗	96,517,177.23	0.76
18	002008	光大银行	88,563,440.46	0.71
19	300070	碧水源	84,288,267.76	0.67
20	002415	海康威视	82,134,750.67	0.66

注：“卖出金额”是指卖出股票成交金额,即成交单价乘以成交量,相关交易费用不考虑。
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)	卖出股票收入(成交总额)		
3,212,406,982.71	6,573,568,607.77		

注:表中“买入股票成本(成交)总额”及“卖出股票收入(成交)总额”均指成交金额,即成交价格乘以成交量,相关交易费用不计入。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元			
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	500,810,000.00	4.01
4	企业债	500,810,000.00	4.01
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	500,810,000.00	4.01

8.6 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

金额单位:人民币元				
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	140429	14国债29	2,000,000	200,340,000.00
2	140437	14国债37	2,000,000	200,300,000.00
3	140430	14国债30	1,000,000	100,170,000.00

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五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。

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 本期国债期货交易投资情况

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

8.11.4 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		
序号	名称	金额
1	存出保证金	661,216.63
2	应收证券清算款	126,839,822.00
3	应收利息	-
4	应收股利	17,381,856.19
5	应收申购款	9,476,528.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	166,368,403.12

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

8.12.1.1 期末指数投资资产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	000062	深圳赛格	201,354,612.18	3.14	融券融券合并质押

8.12.5.2 期末积极投资资产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资产部分股票。

8.9 基金份额持有人信息

单位:人民币元			
持有户数(户)	户均持有的基金份额	机构投资者 持有份额 占总额比例	个人投资者 持有份额 占总额比例
692,713	17,081.19	201,556,420.06 1.96%	10,055,469,552.32 98.04%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额数量(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	5,972,140.73	0.0580%

9.3 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持有本开放式基金	07
本基金基金经理持有本开放式基金	07

§ 10 开放式基金份额变动

基金合同生效日(2009年03月30日)	基金份额总额	基金份额净值
2009年03月30日	12,700,000.00	1.0000
本报告期末基金份额总额	1,020,100,341.16	
减:本报告期间基金总申购款	5,613,736,346.42	
本报告期间基金总赎回款	-	
本报告期间基金总份额变动	-	
本报告期末基金份额总额	10,206,066,352.40	

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动

11.2.1 基金管理人基金托管人的重大人事变动

11.2.1.1 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,夏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和中国证券投资基金业协会备案,秦树兴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。

11.2.2 本报告期基金托管人的重大人事变动

本报告期内,因中国工商银行工作需要,周凤秋同志不再担任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基金托管行业高级管理人员任职资格备案手续前,由副总经理王立波同志代为行使工商银行资产托管部总经理部分业务职责。

11.3 涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼

在本报告期内没有涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金的投资策略未发生变更。

11.5 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170,000.00元。

11.6 报告期内,托管人及其高级管理人员无受监管机构处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位:人民币元					
券商名称	交易单元数量	成交金额	占当期佣金成交总额的比例	应付券商佣金总额	备注
光大证券	1	2,791,482,026.82	28.23%	2,470,184.79	28.23%
中信证券	2	1,288,799,004.29	13.04%	1,140,461.28	13.04%
申银万国	1	1,102,421,571.61	11.15%	975,532.82	11.15%
长江证券	1	1,026,091,412.23	10.44%	913,839.18	10.44%
海通证券	1	926,310,212.74	9.46%	827,472.19	9.46%
华泰证券	1	747,014,659.03	7.56%	661,024.08	7.56%
安信证券	1	706,203,773.62	7.14%	624,969.67	7.14%
长城证券	1	477,327,704.07	4.83%	422,919.61	4.83%
中金公司	1	339,796,081.99	3.44%	300,677.33	3.44%
平安证券	1	269,797,659.94	2.73%	238,744.03	2.73%
广州证券	1	156,467,684.34	1.58%	173,173.63	1.58%
中山证券	1	-	-	-	-
中信万通	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,最近两年未发生重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚;

(4)内部控制规范,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;

(6)研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时为本基金提供高质量的咨询服务,包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告,并能根据基金投资的特定要求,提供专门研究报告;

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程序包括以下四个步骤:

(1)券商服务评价;

(2)拟定租用对象,由研究部根据以上评价结果拟定具备的券商;

(3)上报批准。研究部将拟定租用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、本报告期内基金租用交易单元无变更。

11.7.2 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。

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

融通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。本年度报告为融通通利系列证券投资基金之基金融通债券投资基金(以下简称“本基金”)2014年度报告。

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的法律责任。本年度报告已经三(三)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《融通通利系列证券投资基金合同》的规定,于2015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预示其未来表现。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)为本基金出具了标准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	融通深证100指数
基金代码	161604
前次交易代码	161604
前次交易代码	161604
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年03月30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	10,206,066,352.40份
基金合同存续期限	不定期

2.2 基金产品说明	
投资目标	运用量化投资方式,通过控制股票投资组合与深证100指数的跟踪误差,力求实现对深证100指数的有效跟踪,谋求分享中国宏观经济持续、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,为投资者带来长期稳定回报。
投资策略	以非指数资产90%以上的资产对深证100指数的成份股进行股票指数化投资,股票指数化投资资产不低于基金资产的90%,采用复制跟踪深证100指数,对于流动性条件等限制导致无法完全复制深证100指数的情况,将采用其他合理替代方法进行跟踪误差控制。
业绩比较基准	深证100指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%
风险收益特征	风险收益特征接近股票市场平均水平

2.3 基金管理人及基金托管人	
名称	融通基金管理有限公司
名称	中国工商银行股份有限公司

信息披露负责人	陈卫
联系电话	(0755) 29898866
电子邮箱	service@mail@fund.com.cn
客户服务电话	400-883-8888, (0755) 29898808
传真	(0755) 29893606

载基金净值表现的正文的互联网网址	http://www.fund.com.cn
基金年度信息披露地点	基金管理人处

2.5 其他相关资料	
项目	名称
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册登记机构	融通基金管理有限公司

§ 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	金额单位:人民币元

3.1.1 本期数据和指标	2014年	2013年	2012年
本期已实现收益	-341,038,082.76	-894,658,484.64	-1,095,504,728.46
本期利润	3,343,756,370.06	-538,914,168.23	250,690,807.23
加权平均基金份额本期利润	0.2630	-0.0381	0.0170
本期基金份额净值增长率	32.09%	-4.19%	2.14%

3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额总额	-0.1696	-0.1432	-0.0894
期末基金资产净值	12,476,977,601.32	12,528,136,946.02	14,547,973,622.30
期末基金份额净值	1.212	0.914	0.964

注:1、上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据。

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未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未未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

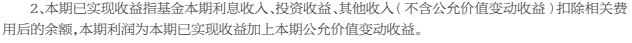
3.2 基金净值表现

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

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	26.51%	1.44%	26.20%	1.41%
过去六个月	42.09%	1.20%	41.78%	1.18%
过去一年	32.09%	1.16%	32.84%	1.15%
过去三年	26.76%	1.30%	32.96%	1.30%
过去五年	-12.07%	1.38%	-8.27%	1.38%
自基金合同生效起至今	26.00%	1.70%	316.0%	0.01%

注:本基金业绩比较基准项目分计算,其中:2006年08月21日之前(含当日)采用“深证100指数×75%+银行间债券综合指数×25%”,2006年08月22日起使用新基准即“深证100指数收益率×95%+银行间同业存款利率×5%”。

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



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较