

融通通利系列证券投资基金之融通债券投资基金

2014 年度报告摘要

60%、日兴资产管理(中国)有限公司(Nikko Asset Management Co., Ltd.)40%。

截至2014年12月31日,公司管理的基金共有二十六只;一只封闭式基金,即融通乾封债基金;二十五只开放式基金,即融通新蓝筹混合基金、融通债券基金、融通深证100指数基金、融通蓝筹成长混合基金、融通行业景气混合基金、融通目标100指数基金(LOP)、融通货币支付货币基金、融通动力先锋股票基金、融通领先成长股票基金(LOP)、融通内需驱动股票基金、融通深证成份指数基金、融通四季债券基金、融通创业板指数基金、融通医疗保健行业股票基金、融通岁岁定期开放债券基金、融通季利四分法(ODD-POF)基金、融通七天理财债券基金、融通转债中国可转债指数增强基金、融通通泰保本混合基金、融通通利混合基金、融通通利分级债券基金、融通通利融资融券基金、融通通利货币基金、融通月月添利基金和融通健康产业基金。其中,融通债券基金、融通深证100指数基金和融通蓝筹成长混合基金同属融通通利系列证券投资基金。此外,公司还开展了特定客户资产管理业务。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

Table with columns: Name, Position, Tenure, and Description of fund managers.

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 管理人对于报告期内本基金遵守信托信情况的说明

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、《融通通利系列证券投资基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人的行为,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 管理人对于报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和内部控制方法
为了保障旗下不同投资组合得到公平对待,本基金管理人制定了《融通基金管理有限公司公平交易制度》,并涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

4.3.2 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,在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。

4.3.3 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。

4.3.4 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
2014年以来,宏观经济表现疲弱,工业增加值下行幅度较大,工业品价格下跌趋势明显,社融增速有所下降,且非理性明显。出于稳定经济增长及降低融资成本的需要,央行开启了略微宽松的货币政策。

4.3.5 基金管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
2014年以来,宏观经济表现疲弱,工业增加值下行幅度较大,工业品价格下跌趋势明显,社融增速有所下降,且非理性明显。出于稳定经济增长及降低融资成本的需要,央行开启了略微宽松的货币政策。

4.3.6 基金管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
2014年以来,宏观经济表现疲弱,工业增加值下行幅度较大,工业品价格下跌趋势明显,社融增速有所下降,且非理性明显。出于稳定经济增长及降低融资成本的需要,央行开启了略微宽松的货币政策。

4.3.7 基金管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
2014年以来,宏观经济表现疲弱,工业增加值下行幅度较大,工业品价格下跌趋势明显,社融增速有所下降,且非理性明显。出于稳定经济增长及降低融资成本的需要,央行开启了略微宽松的货币政策。

4.3.8 基金管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
2014年以来,宏观经济表现疲弱,工业增加值下行幅度较大,工业品价格下跌趋势明显,社融增速有所下降,且非理性明显。出于稳定经济增长及降低融资成本的需要,央行开启了略微宽松的货币政策。

4.3.9 基金管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
2014年以来,宏观经济表现疲弱,工业增加值下行幅度较大,工业品价格下跌趋势明显,社融增速有所下降,且非理性明显。出于稳定经济增长及降低融资成本的需要,央行开启了略微宽松的货币政策。

4.3.10 基金管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
2014年以来,宏观经济表现疲弱,工业增加值下行幅度较大,工业品价格下跌趋势明显,社融增速有所下降,且非理性明显。出于稳定经济增长及降低融资成本的需要,央行开启了略微宽松的货币政策。

4.3.11 基金管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
2014年以来,宏观经济表现疲弱,工业增加值下行幅度较大,工业品价格下跌趋势明显,社融增速有所下降,且非理性明显。出于稳定经济增长及降低融资成本的需要,央行开启了略微宽松的货币政策。

4.3.12 基金管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
2014年以来,宏观经济表现疲弱,工业增加值下行幅度较大,工业品价格下跌趋势明显,社融增速有所下降,且非理性明显。出于稳定经济增长及降低融资成本的需要,央行开启了略微宽松的货币政策。

4.3.13 基金管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
2014年以来,宏观经济表现疲弱,工业增加值下行幅度较大,工业品价格下跌趋势明显,社融增速有所下降,且非理性明显。出于稳定经济增长及降低融资成本的需要,央行开启了略微宽松的货币政策。

4.3.14 基金管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
2014年以来,宏观经济表现疲弱,工业增加值下行幅度较大,工业品价格下跌趋势明显,社融增速有所下降,且非理性明显。出于稳定经济增长及降低融资成本的需要,央行开启了略微宽松的货币政策。

4.3.15 基金管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
2014年以来,宏观经济表现疲弱,工业增加值下行幅度较大,工业品价格下跌趋势明显,社融增速有所下降,且非理性明显。出于稳定经济增长及降低融资成本的需要,央行开启了略微宽松的货币政策。

4.3.16 基金管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
2014年以来,宏观经济表现疲弱,工业增加值下行幅度较大,工业品价格下跌趋势明显,社融增速有所下降,且非理性明显。出于稳定经济增长及降低融资成本的需要,央行开启了略微宽松的货币政策。

4.3.17 基金管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
2014年以来,宏观经济表现疲弱,工业增加值下行幅度较大,工业品价格下跌趋势明显,社融增速有所下降,且非理性明显。出于稳定经济增长及降低融资成本的需要,央行开启了略微宽松的货币政策。

4.3.18 基金管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
2014年以来,宏观经济表现疲弱,工业增加值下行幅度较大,工业品价格下跌趋势明显,社融增速有所下降,且非理性明显。出于稳定经济增长及降低融资成本的需要,央行开启了略微宽松的货币政策。

4.3.19 基金管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
2014年以来,宏观经济表现疲弱,工业增加值下行幅度较大,工业品价格下跌趋势明显,社融增速有所下降,且非理性明显。出于稳定经济增长及降低融资成本的需要,央行开启了略微宽松的货币政策。

4.3.20 基金管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
2014年以来,宏观经济表现疲弱,工业增加值下行幅度较大,工业品价格下跌趋势明显,社融增速有所下降,且非理性明显。出于稳定经济增长及降低融资成本的需要,央行开启了略微宽松的货币政策。

4.3.21 基金管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
2014年以来,宏观经济表现疲弱,工业增加值下行幅度较大,工业品价格下跌趋势明显,社融增速有所下降,且非理性明显。出于稳定经济增长及降低融资成本的需要,央行开启了略微宽松的货币政策。

4.3.22 基金管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
2014年以来,宏观经济表现疲弱,工业增加值下行幅度较大,工业品价格下跌趋势明显,社融增速有所下降,且非理性明显。出于稳定经济增长及降低融资成本的需要,央行开启了略微宽松的货币政策。

4.3.23 基金管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
2014年以来,宏观经济表现疲弱,工业增加值下行幅度较大,工业品价格下跌趋势明显,社融增速有所下降,且非理性明显。出于稳定经济增长及降低融资成本的需要,央行开启了略微宽松的货币政策。

4.3.24 基金管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
2014年以来,宏观经济表现疲弱,工业增加值下行幅度较大,工业品价格下跌趋势明显,社融增速有所下降,且非理性明显。出于稳定经济增长及降低融资成本的需要,央行开启了略微宽松的货币政策。

4.3.25 基金管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
2014年以来,宏观经济表现疲弱,工业增加值下行幅度较大,工业品价格下跌趋势明显,社融增速有所下降,且非理性明显。出于稳定经济增长及降低融资成本的需要,央行开启了略微宽松的货币政策。

494.29份。

7.2 利润表

会计主体:融通债券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

Profit Statement table for Rongtong Bond Investment Fund, showing revenue, expenses, and net profit for 2014 and 2013.

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:融通债券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

Equity Statement table for Rongtong Bond Investment Fund, showing changes in net assets for 2014 and 2013.

注:后附7.4报表附注为本财务报表的重要组成部分。

本报告17至7.4财务报表由下列负责人签署:

基金管理机构负责人:孟朝晖 主管会计工作负责人:颜福耀 会计机构负责人:刘美丽

7.4 关联方关系

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告保持一致

7.4.2 本报告期无重大会计差错内容和更正金额。

7.4.3 关联交易情况

Table of related party transactions, including fund management fees, custody fees, and other services.

注:1、支付基金管理人融通基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

注:2、客户维护费是基金管理人及基金销售机构约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的费用,用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支,不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.4.2 基金托管费

Table of fund custody fees for 2014 and 2013.

注:支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.4.2.3 销售服务费

Table of sales service fees for 2014 and 2013.

注:支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.4.2.3 销售服务费

Table of sales service fees for 2014 and 2013.

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值0.35%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

Table of bond transactions with related parties.

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

Table of investments in the fund by related parties.

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

Table of investments in the fund by the fund manager.

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

Table of investments in the fund by other related parties.

7.4.4.5 因申购赎回/增发/赎回于期末未持有的流通受限证券

Table of restricted securities at the end of the period.

7.4.5 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额39,999,820.00元,是以以下债券作为质押:

Table of securities used as collateral for reverse repurchase transactions.

7.4.5.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额132,600,000.00元,于2015年1月5日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

8.1 期末基金资产组合情况

Table of fund asset composition at the end of the period.

8.2 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table of bond portfolio by category at the end of the period.

8.3 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 of top 5 bond investments by fair value at the end of the period.

8.4 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 of top 5 warrant investments by fair value at the end of the period.

8.5 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贵金属投资明细

Table of top 5 precious metal investments by fair value at the end of the period.

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权证投资明细

Table of top 5 warrant investments by fair value at the end of the period.

8.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

Table of futures trading at the end of the period.

8.7.4 本期国债期货投资政策

8.7.5 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table of treasury futures positions and P&L at the end of the period.

8.7.6 本期国债期货投资评价

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 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。

8.8.2 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table of convertible bonds at the end of the period.

8.8.3 基金管理人持有的处于转股期的可转换债券明细

Table of convertible bonds held by the fund manager at the end of the period.

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table of fund shareholders at the end of the period.

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

Table of fund manager staff holding the fund at the end of the period.

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额区间的情况

Table of fund manager staff holding the fund at the end of the period.

11.1 基金份额持有人大会决议

11.2 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

11.3 涉及基金管理人、基金托管人、基金销售机构的诉讼事项

11.4 基金投资策略的改变

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情形

11.7 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及债券支付情况

Table of securities used for investment and payment at the end of the period.

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法违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚;
(4) 内部控制制度严格,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,并能与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、本基金本报告期和上年度可比期间均未买入管理人、托管人的控股股东(非控股)在承销期间承销的证券;
3、本报告期内基金租用交易单元无变更。