

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

[2015] 第二季度报告

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:2015年7月20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。本报告为融通通利系列证券投资基金之子基金融通深证100指数证券投资基金(以下简称“本基金”)2015年第2季度报告。

基金管理人的董事、监事及董事会秘书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《融通通利系列证券投资基金基金合同》规定,于2015年7月16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2015年4月1日起至2015年6月30日止。

§ 2 基本产品概况

基金简称	融通深证100指数
交易代码	161604
前庭交易代码	161604
后庭交易代码	161654
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年9月30日
报告期末基金的份额总额	5,080,522,896.27份
报告期净值增长率	7.943,993,537.58%
报告期净值增长率	94.69%

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标				
报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)				
1.本期的实现收益		2,394,883,049.78		
2.期初累计净值		1,764,766,473.68		
3.加权平均基金份额利润		0.2630		
4.期末基金份额净值		8,389,119,763.44		
5.期末基金份额净值		1.651		

注:1.本期已实现收益指基金本期利润收入,投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关税费后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

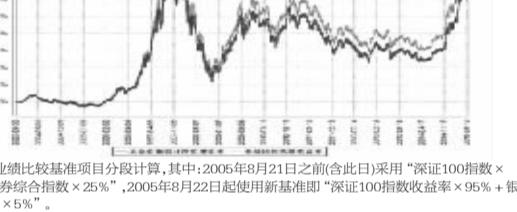
2.本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计人费用后实际收益水平将低于所列示;

3.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	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-④
过去三个月	12.47%	2.61%	13.25%	2.50%	-0.78%

3.2.2 基金合同生效以来基金份额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:本基金业绩比较基准项目分段计算,其中:2005年8月21日之前(含此日)采用“深证100指数×75%+银行间同业拆借指数×25%”,2005年8月22日起使用新基准即“深证100指数收益率×95%+银行间存款利率×5%”。

§ 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
何天翔	本基金的基金经理	2010年10月25日	-	6

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日期为计算标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵守法律法规的情况的说明

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金合同的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理本基金,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋取最大利益,无损害基金持有人利益的行为,本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、业绩评比等各个环节保证公平交易制度的严格执行。报告期内,基金管理人严格执行公平交易的原则和操作分析

4.3.2 公平交易制度的执行情况

4.3.3 公平交易制度的执行情况

4.3.4 公平交易制度的执行情况

4.3.5 公平交易制度的执行情况

4.3.6 公平交易制度的执行情况

4.3.7 公平交易制度的执行情况

4.3.8 公平交易制度的执行情况

4.3.9 公平交易制度的执行情况

4.3.10 公平交易制度的执行情况

4.3.11 公平交易制度的执行情况

4.3.12 公平交易制度的执行情况

4.3.13 公平交易制度的执行情况

4.3.14 公平交易制度的执行情况

4.3.15 公平交易制度的执行情况

4.3.16 公平交易制度的执行情况

4.3.17 公平交易制度的执行情况

4.3.18 公平交易制度的执行情况

4.3.19 公平交易制度的执行情况

4.3.20 公平交易制度的执行情况

4.3.21 公平交易制度的执行情况

4.3.22 公平交易制度的执行情况

4.3.23 公平交易制度的执行情况

4.3.24 公平交易制度的执行情况

4.3.25 公平交易制度的执行情况

4.3.26 公平交易制度的执行情况

4.3.27 公平交易制度的执行情况

4.3.28 公平交易制度的执行情况

4.3.29 公平交易制度的执行情况

4.3.30 公平交易制度的执行情况

4.3.31 公平交易制度的执行情况

4.3.32 公平交易制度的执行情况

4.3.33 公平交易制度的执行情况

4.3.34 公平交易制度的执行情况

4.3.35 公平交易制度的执行情况

4.3.36 公平交易制度的执行情况

4.3.37 公平交易制度的执行情况

4.3.38 公平交易制度的执行情况

4.3.39 公平交易制度的执行情况

4.3.40 公平交易制度的执行情况

4.3.41 公平交易制度的执行情况

4.3.42 公平交易制度的执行情况

4.3.43 公平交易制度的执行情况

4.3.44 公平交易制度的执行情况

4.3.45 公平交易制度的执行情况

4.3.46 公平交易制度的执行情况

4.3.47 公平交易制度的执行情况

4.3.48 公平交易制度的执行情况

4.3.49 公平交易制度的执行情况

4.3.50 公平交易制度的执行情况

4.3.51 公平交易制度的执行情况

4.3.52 公平交易制度的执行情况

4.3.53 公平交易制度的执行情况

4.3.54 公平交易制度的执行情况

4.3.55 公平交易制度的执行情况

4.3.56 公平交易制度的执行情况

4.3.57 公平交易制度的执行情况

4.3.58 公平交易制度的执行情况

4.3.59 公平交易制度的执行情况

4.3.60 公平交易制度的执行情况

4.3.61 公平交易制度的执行情况

4.3.62 公平交易制度的执行情况

4.3.63 公平交易制度的执行情况

4.3.64 公平交易制度的执行情况

4.3.65 公平交易制度的执行情况

4.3.66 公平交易制度的执行情况

4.3.67 公平交易制度的执行情况

4.3.68 公平交易制度的执行情况

4.3.69 公平交易制度的执行情况

4.3.70 公平交易制度的执行情况

4.3.71 公平交易制度的执行情况

4.3.72 公平交易制度的执行情况

4.3.73 公平交易制度的执行情况

4.3.74 公平交易制度的执行情况

4.3.75 公平交易制度的执行情况

4.3.76 公平交易制度的执行情况

4.3.77 公平交易制度的执行情况

4.3.78 公平交易制度的执行情况

4.3.79 公平交易制度的执行情况

4.3.80 公平交易制度的执行情况

4.3.81 公平交易制度的执行情况

4.3.82 公平交易制度的执行情况

4.3.83 公平交易制度的执行情况

4.3.84 公平交易制度的执行情况

4.3.85 公平交易制度的执行情况

4.3.86 公平交易制度的执行情况

4.3.87 公平交易制度的执行情况

4.3.88 公平交易制度的执行情况

4.3.89 公平交易制度的执行情况

4.3.90 公平交易制度的执行情况

4.3.91 公平交易制度的执行情况

4.3.92 公平交易制度的执行情况

4.3.93 公平交易制度的执行情况

4.3.94 公平交易制度的执行情况

4.3.95 公平交易制度的执行情况

4.3.96 公平交易制度的执行情况

4.3.97 公平交易制度的执行情况

4.3.98 公平交易制度的执行情况

4.3.99 公平交易制度的执行情况

4.3.100 公平交易制度的执行情况