

融通内需驱动股票型证券投资基金

【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

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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本基金合同规定,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。

本报告期内未发生基金份额赎回。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通内需驱动股票
交易代码	161611
前端交易代码	161611
后端交易代码	161661
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年4月22日
报告期末基金份额总额	414,560,231.51份
投资目标	本基金主要投资于由国内投资需求和消费需求所驱动的优势企业,分享中国经济增长及增长方式转变所带来的收益,实现基金资产可持续发展的稳定增值。
投资策略	本基金重点投资于由国内投资需求和消费需求所驱动的优势企业,根据经济演进的规律和产业变迁的路径,自上而下“确定资产配置与行业配置比例,在行业配置下“自下而上”精选个股。本基金股票资产主要投资于治理规范、经营稳健、财务良好和盈利能力强的内需驱动型优秀公司,但是,只有满足“规范、独特、简单、成长”特性的龙头企业才有可能成为我们的核心资产,对这部分资产,我们将长期持有,充分分享中国经济长期高速增长和企业做大做强所带来的巨大收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中信标普全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于中高风险收益的基金品种,其收益和风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2015年4月1日—2015年6月30日)
1.本期已实现收益	97,023,126.13
2.本期利润	-11,582,833.92
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0068
4.期末基金资产净值	571,708,473.18
5.期末基金份额净值	1.379

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下列数字。

§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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	26.63%	3.22%	8.87%	2.09%	17.76%	1.13%

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

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期 离任日期	证券从业年限	说明
杨博瑞	本基金、融通动力先锋股票、融通新区域新经济灵活配置混合的基金经理	2015年4月28日	5	金融学硕士,毕业于北京大学光华管理学院,具有基金从业资格。2010年7月至2014年12月在华夏基金管理有限公司投资研究部工作,历任研究员、TMT研究组长。2014年12月加入融通基金管理有限公司。
周鼎	本基金的基金经理	2012年1月5日 2015年4月28日	7	硕士,具有基金从业资格。2008年3月至今,就职于融通基金管理有限公司,从事宏观策略研究、行业研究、周期性研究工作。

注:任职日期和离任日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写;证券从业年限从事证券业务相关工作时间计算。

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,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、《融通内需驱动股票型证券投资基金合同》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、交易和投资等环节保证公平交易制度的严格执行。报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易制度的相关规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未发生异常交易。
4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
2015年一季度,市场先是延续了第一季度的火热走势,在6月中旬出现系统性暴跌,最终大盘上涨8.16%,创业板上涨18.17%。

报告期内,本基金主要仓位配置在新兴成长行业,包括汽车后市场、工业4.0,以及一些传统行业转型企业,也配置了一些国企改革股,在4月份以及5月份,组合表现较好,最高时二季度相对收益超过了40%。

随之,从6月中旬开始,市场开始出现系统性风险,本基金在仓位上做了一定调整,降了一些仓位,但由于结构上以中小市值的成长股为主,在此期间回撤较大。

4.5 报告期内基金业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为26.63%,同期业绩比较基准收益率为8.87%。
4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明
无。

§5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	461,729,090.23	71.19
	其中:股票	461,729,090.23	71.19
2	固定收益投资	—	—
	其中:债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	182,295,004.65	28.11
7	其他资产	4,543,566.83	0.70
8	合计	648,567,661.71	100.00

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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本基金合同规定,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。

本报告期内未发生基金份额赎回。

本报告期自2015年4月1日起至2015年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通岁岁添利定期开放债券
交易代码	161618
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年11月6日
报告期末基金份额总额	226,967,446.28份
投资目标	在严格控制投资风险的基础上,追求基金资产的长期稳定增值,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金主要投资于固定收益类品种,不直接买入股票、权证等权益类金融工具。本基金封闭期的投资组合久期与封闭期期限进行适当匹配。本基金的具体投资策略包括资产配置策略、利率策略、信用策略、类属配置与个券选择策略,可转换债券投资策略以及资产支持证券的投资策略等部分。
业绩比较基准	一年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	属于证券投资基金中的低风险品种
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
下属分级基金的基金简称	融通岁岁添利定期开放债券A类
下属分级基金的交易代码	161618
报告期末下属分级基金的份额总额	156,025,570.26份

§3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2015年4月1日—2015年6月30日)
基金简称	融通岁岁添利定期开放债券A类
1.本期已实现收益	3,854,539.72
2.本期利润	6,620,388.25
3.加权平均基金份额本期利润	0.0024
4.期末基金资产净值	174,667,864.06
5.期末基金份额净值	1.119

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下列数字。

§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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.90%	0.14%	0.59%	0.01%	3.31%	0.13%

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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.81%	0.13%	0.59%	0.01%	3.22%	0.12%

3.2.3 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

§2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	336,662,787.76	62.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	396,105.36	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	5,364,647.00	0.94
H	住宿和餐饮业	5,390,828.35	0.94
I	信息传输、软件和信息技术服务业	72,882,273.36	12.75
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	2,192,702.40	0.38
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	10,987,746.00	1.92
R	文化、体育和娱乐业	7,852,000.00	1.37
S	综合	—	—
合计		461,729,090.23	80.76

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	603898	好莱客	424,511	46,471,219.17	8.13
2	002612	朗姿股份	549,980	37,096,151.00	6.49
3	300163	先锋新材	1,150,877	36,298,660.58	6.35
4	300195	长荣股份	1,114,600	31,610,056.00	5.53
5	300174	元力股份	1,066,600	29,139,512.00	5.10
6	002665	晋亿智能	943,250	27,674,955.00	4.84
7	300431	暴风科技	112,200	23,724,690.00	4.15
8	300046	合盛股份	978,774	23,010,976.74	4.02
9	002044	江苏三友	511,091	22,896,876.80	4.00
10	300075	数字政通	601,748	22,679,882.12	3.97

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	627,334.37
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	25,382.32
5	应收申购款	3,890,650.14
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	4,543,566.83

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末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	603898	好莱客	46,471,219.17	8.13	重大资产重组
2	300163	先锋新材	36,298,660.58	6.35	重大资产重组
3	300195	长荣股份	31,610,056.00	5.53	重大资产重组
4	002665	晋亿智能	27,674,955.00	4.84	重大资产重组
5	300431	暴风科技	23,724,690.00	4.15	重大资产重组
6	002044	江苏三友	22,896,876.80	4.00	重大资产重组停牌

§6 开放式基金份额变动

序号	项目	金额(元)
1	报告期期初基金份额总额	299,574,971.62
2	报告期内基金总申购份额	361,885,784.65
3	减:报告期内基金总赎回份额	246,900,524.76
4	报告期内基金拆分变动份额	—
5	报告期末基金份额总额	414,560,231.51

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
(一)中国证监会批准融通内需驱动股票型证券投资基金设立的文件
(二)《融通内需驱动股票型证券投资基金合同》
(三)《融通内需驱动股票型证券投资基金托管协议》
(四)《融通内需驱动股票型证券投资基金招募说明书》及其更新
(五)融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
(六)报告期内在指定报刊上披露的各项公告

8.2 存放地点
基金管理人处、基金托管人处

8.3 查阅方式
投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件,或登陆本基金管理人网站http://www.rtfund.com查询。

融通基金管理有限公司
二〇一五年七月二十日

融通深证成份指数证券投资基金

【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

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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本基金合同规定,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。

本报告期内未发生基金份额赎回。

本报告期自2015年4月1日起至2015年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通深证成份指数
交易代码	161612
前端交易代码	161612
后端交易代码	161662
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年11月15日
报告期末基金份额总额	221,667,920.08份
投资目标	本基金采取完全复制方法进行指数化投资,通过严格的投资纪律和数量化风险管理手段,力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%以内,以求实现对深证成份指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金,原则上采用完全复制指数的投资策略,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整,力争实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%的投资目标。
业绩比较基准	深证成份指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,属于中高风险收益的基金品种,其收益和风险均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2015年4月1日—2015年6月30日)
1.本期已实现收益	238,987,145.76
2.本期利润	88,517,011.73
3.加权平均基金份额本期利润	0.2113
4.期末基金资产净值	252,669,878.43
5.期末基金份额净值	1.140

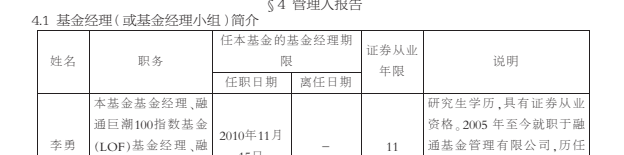
注:(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

(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下列数字。

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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.15%	2.66%	8.60%	2.58%	-2.45%	0.08%

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



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
报告期内,本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、交易和业绩评价等各个环节保证公平交易制度的严格执行。报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易制度的相关规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
本基金本报告期内未发生异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
本基金为被动式指数基金,原则上采用完全复制指数的投资策略,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整,力争实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差小于0.35%,年化跟踪误差控制在4%的投资目标。

2015年一季度,市场先是延续了第一季度的火热走势,在6月中旬出现系统性暴跌,最终大盘上涨10.41%,从各行业类指数的表现来看,除银行股(申万)下跌外,其它板块涨幅,其中轻工制造(申万)、国防军工(申万)领涨。

4.5 报告期内基金的业绩表现
本报告期基金份额净值增长率为6.15%,同期业绩比较基准收益率为8.60%。

4.6 报告期末基金持有人人数或基金资产净值预警说明
无。

§5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)
----	----	-------