

基金管理人：融通基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：2015年10月23日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会在报告中所披露资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人和基金管理人根据有关法律法规的规定，于2015年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，保证复核后的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，投资者在做出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告所含财务数据未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称	融通债券封闭
交易代码	500038
基金运作方式	契约封闭式
基金合同生效日	2001年7月1日
报告期末基金份额总额	2,000,000,000.00份
报告期末总资产	2,000,000,000.00元
报告期末总负债	-3,010,908,701.88元
基金份额净值	1.5665

§ 3 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标		报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益		-235,638,300.00
2.本期利润		-699,276,350.47
3.本期平均基金份额利润		-0.3250
4.期末基金份额净值		3.010,908,701.88
5.期末可供分配基金份额净值		1.5665

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的公允价值变动收益。

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, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	净值增长率为(%)	净值增长率为(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率(%)	收益率差(%)	① - ③	② - ④
过去三个月	-1.90%	2.77%	-	-	-	-	-

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至2015年9月30日,基金份额净值增长率为1.5665%,同期业绩比较基准收益率为-1.79%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无

5.4 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任聘日期 离任日期 证券从业年限 情况

郭鹏 本基金的基金经理 2016年1月6日 - 9 经济学硕士, 具有基金从业资格。2006年4月至2007年12月就职于海通证券从事证券投资工作;2008年1月加入融通基金管理有限公司, 从证券投资研究员做起, 后任债券研究员、基金经理助理, 2010年4月至2012年12月, 在宏观证券分析师岗位上工作;2013年1月至今, 在公司宏观策略组担任基金经理助理, 2013年10月加入融通基金管理有限公司, 从事研究工作。

张延 本基金、融通货币基金经理 2014年10月 - 6 硕士, 具有基金从业资格。2010年1月至今, 就职于融通基金管理有限公司, 从事机械、新能源、汽车行业研究工作。

注:任期内根据基金管理人对外披露的任职日期计算;证券从业年限从从事证券业务相关的工作时间为起算标准。

4.2. 管理人报告期内本基金运作合规性情况说明

本报告期内基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规和本基金合同的规定, 本基金管理人勤勉尽责的履行基金管理职责, 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. 公平交易制度的执行情况

本基金管理人制定了公平交易制度, 并对旗下所有投资组合实行公平交易制度, 制定了相应的制度和流程, 在授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个方面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的内部控制制度。

4.4. 防范利益输送的专项说明

本基金管理人将遵循《证券投资基金法》等法律法规和本基金合同的规定, 本基金管理人勤勉尽责的履行基金管理职责, 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。

4.5. 报告期内基金投资组合报告

5.5.1 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 510,206,534.95 48.36

其中:股票 1,520,206,534.95 48.36

2 固定收益投资 1,320,744,000.00 42.01

其中:债券 1,320,744,000.00 42.01

货币市场基金 - -

3 贵金属投资 - -

4 衍生工具 - -

5 买入返售金融资产 - -

6 其他资产 251,765,806.91 8.01

7 其他资产 51,368,016.13 1.63

8 合计 3,144,103,357.89 100.00

注:本基金合同生效以来至2015年9月30日,本基金资产净值增长率为1.5665%。

5.5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 代码 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 农林牧渔业 A 823,301,394.95 27.34

2 采掘业 B 41,360,000.00 1.39

3 制造业 C 119,549,709.46 3.97

4 电力、热力、燃气及水生产和供应业 D 108,794,676.42 3.61

5 建筑业 E - -

6 交通运输、仓储和邮政业 F - -

7 信息传输、软件和信息技术服务业 G - -

8 其他行业 H 142,512,249.60 4.73

9 房地产业 I 162,016,387.75 5.38

10 电子通信设备 J - -

11 机械设备 K - -

12 公用事业 L - -

13 交通运输设备 M - -

14 化工石化新材料 N 122,171,024.77 4.06

15 电子元器件 O - -

16 有色金属冶炼和压延加工业 P - -

17 电气机械和器材制造业 Q - -

18 仪器仪表 R - -

19 其他制造业 S - -

20 其他服务业 T - -

21 其他 T 1,020,206,153.85 60.49

注:本基金合同生效以来至2015年9月30日,本基金资产净值增长率为1.5665%。

5.5.3 报告期末按行业分类的债券投资组合

序号 行业类别 代码 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 3,969,639 1.00

2 地方债 4,352,374 1.36

3 新债 2,849,909 0.88

4 外币债 4,009,746 1.24

5 企业债 1,500,000 0.47

6 可转债 1,498,713 0.48

7 政府债 83,880,347.46 2.79

8 国债 1,498,713 0.48

9 中票 6,338,566 0.21

10 四电 6,414,011.02 0.21

11 四电 1,000,000 0.03

12 宝生债 1,675,927 0.54

13 四电 58,841,796.97 1.96

注:本基金合同生效以来至2015年9月30日,本基金资产净值增长率为1.5665%。

5.5.4 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股票投资组合

序号 代码 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000024 招商银行 3,969,639 1.00

2 600035 中国平安 4,352,374 1.36

3 600687 新华保险 2,849,909 0.88

4 600707 中国太保 4,009,746 1.24

5 600924 中国国航 1,500,000 0.47

6 601318 中国银行 1,498,713 0.48

7 601818 中国石油 83,880,347.46 2.79

8 601913 中国建筑 6,338,566 0.21

9 601993 中国重工 6,414,011.02 0.21

10 602007 中国人寿 1,000,000 0.03

注:本基金合同生效以来至2015年9月30日,本基金资产净值增长率为1.5665%。

5.5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

序号 代码 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 100024 招商银行 3,969,639 1.00

2 600035 中国平安 4,352,374 1.36

3 600687 新华保险 2,849,909 0.88

4 600707 中国太保 4,009,746 1.24

5 600924 中国国航 1,500,000 0.47

6 601318 中国银行 1,498,713 0.48

7 601818 中国石油 83,880,347.46 2.79

8 601913 中国建筑 6,338,566 0.21

9 601993 中国重工 6,414,011.02 0.21

10 602007 中国人寿 1,000,000 0.03

注:本基金合同生效以来至2015年9月30日,本基金资产净值增长率为1.5665%。

5.5.6 报告期末按