

融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)

【2015】第三季度报告

§ 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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
李勇	本基金的基金经理 (一) 融通巨潮100指数证券投资基金基金经理 (二) 融通领先成长混合型证券投资基金基金经理	2015年1月29日	-	11	清华大学工学学士,具有证券从业资格,2005年至今就职于融通基金管理有限公司,历任金融工程研究员、基金经理助理、基金经理。
陈伟杰	本基金基金经理	2015年2月21日	-	3	硕士,具有基金从业资格,2006年2月加入融通基金管理有限公司,在汇添富基金管理股份有限公司工作,历任数量化工程师,2011年6月加入融通基金管理有限公司,任金融工程研究员。

注:任职日期指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的工作时间为计算标准。

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、交易和业绩评估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的原则和制度。

4.3.2 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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

在严格遵守基金合同的前提下实现持有人利益的最大化是本基金管理的核心理念,并将此原则贯彻于基金的运作之中。本基金运用指数化投资方式,通过控制股票投资权重与巨潮100指数的成份股自然权重的偏离,减少基金相对巨潮100指数基金基准的跟踪误差,力求最终实现对巨潮100指数基金基准的有效跟踪。

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-26.42%,同期业绩比较基准收益率为-26.01%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

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	769,590,167.92	94.11
2	其中:股票	769,590,167.92	94.11
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买入返售的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	47,619,090.53	5.82
10	其他资产	608,286.77	0.07
11	合计	818,219,363.22	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	-	-	-
D 电力、热力、燃气及生产和服务供应业	-	-	-
E 建筑业	-	-	-
F 批发和零售业	-	-	-
G 交通运输、仓储和邮政业	-	-	-
H 住宿和餐饮业	-	-	-
I 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-	-
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	-	-	-
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	-	-	-
R 文化、体育和娱乐业	-	-	-
S 综合	-	-	-
合计	-	5,349,535,038.86	77.00

5.2.2 报告期末非指数投资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	-	-	-
D 电力、热力、燃气及生产和服务供应业	-	-	-
E 建筑业	-	-	-
F 批发和零售业	-	-	-
G 交通运输、仓储和邮政业	-	-	-
H 住宿和餐饮业	-	-	-
I 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-	-
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	-	-	-
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	-	-	-
R 文化、体育和娱乐业	-	-	-
S 综合	-	-	-
合计	-	5,349,535,038.86	77.00

5.2.3 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明细

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明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

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。

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有权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.1 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。

1.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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。

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。

10.3 本期国债期货投资政策的说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

11 投资组合报告附注

11.1 本基金投资的前十名股票中投资涉及主体报告期内未有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到过公开谴责、处罚。

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。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,117,090.00
2	应收证券利息	51,108,376.00
3	应收股利	-
4	应收利息	566,604.51
6	应收申购款	3,072,130.00
7	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

5.2.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

15. 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	002193	华鲁恒升	617,521,066.26	0.89	重大资产重组
2	002174	鑫磊股份	473,396,346.34	0.81	重大资产重组

§ 6 开放式基金份额变动

单位	
报告期初基金份额总额	6,126,746,203.64
报告期间基金份额申购总额	2,241,678,282.68
减：报告期间基金份额赎回总额	2,622,320,742.36
报告期末基金份额总额	5,745,093,743.96

5.2.5 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

报告期末前10名自然人持有的本基金份额	8,244,122.00
报告期末前10名法人申购份额	4,009,386.07
报告期末前10名赎回份额	-
报告期末前10名基金持有人持有的本基金份额	12,253,508.07
报告期末前10名持有的本基金份额占本基金总份额比例(%)	0.18

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用税率
1	网上交易申购	2015-7-16	2,069,308.07	2,500,000.00	0.00%
2	网上直销申购	2015-7-17	1,960,078.00	2,500,000.00	0.00%
合计	-	-	4,009,386.07	5,000,000.00	-

5.2.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

二)	融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》
三)	融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)托管协议》
四)	融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)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
7.	存放地点
基金管理人、基金托管人处、深圳证券交易所。	
8.	查阅方式

5.2.7 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股指期货投资明细

2015年10月

5.2.8 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国债期货投资明细

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	002193	华鲁恒升	617,521,066.26	6.89	
2	300067	东方电力	9,201,304	518,711,328.48	7.47
3	002096	伟明纸业	19,093,270	500,246,204.00	7.30
4	002488	金隅股份	24,709,546	478,129,095.76	6.88
5	002174	鑫磊股份	7,187,019	473,396,346.34	6.81
6	300332	方邦股份	18,942,764	384,538,109.20	5.54
7	002090	美芝股份	9,999,462	272,796,363.88	3.98
8	300104	奇安信	6,102,268	249,485,461.08	3.59
9	300137	华信股份	12,849,840	207,622,342.40	2.99
10	300276	福耀玻璃	5,106,149	198,833,442.06	2.88

5.2.9 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商品期货投资明细

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	002193	华鲁恒升	617,521,066.26	6.89	
2	300067	东方电力	9,201,304	518,711,328.48	7.47
3	002096	伟明纸业	19,093,270	500,246,204.00	7.30
4	002488	金隅股份	24,709,546	478,129,095.76	6.88
5	002174	鑫磊股份	7,187,019	473,396,346.34	6.81
6	300332	方邦股份	18,942,764	384,538,109.20	5.54
7	002090	美芝股份	9,999,462	272,796,363.88	3.98
8	300104	奇安信	6,102,268	249,485,461.08	3.59
9	300137	华信股份	12,849,840	207,622,342.40	2.99
10	300276	福耀玻璃	5,106,149	198,833,442.06	2.88

5.2.10 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资产支持证券投资明细

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	002193	华鲁恒升	617,521,066.26	6.89	
2	300067	东方电力	9,201,304	518,711,328.48	7.47
3	002096	伟明纸业	19,093,270	500,246,204.00	7.30
4	002488	金隅股份	24,709,546	478,129,095.76	6.88
5	002174	鑫磊股份	7,187,019	473,396,346.34	6.81
6	300332	方邦股份	18,942,764	384,538,109.20	5.54
7	002090	美芝股份	9,999,462	272,796,363.88	3.98
8	300104	奇安信	6,102,268	249,485,461.08	3.59
9	300137	华信股份	12,849,840	207,622,342.40	2.99
10	300276	福耀玻璃	5,106,149	198,833,442.06	2.88

5.2.11 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衍生品投资明细

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	002193	华鲁恒升	617,521,066.26	6.89	
2	300067	东方电力	9,201,304	518,711,328.48	7.47
3	002096	伟明纸业	19,093,270	500,246,204.00	7.30
4	002488	金隅股份	24,709,546	478,129,095.76	6.88
5	002174	鑫磊股份	7,187,019	473,396,346.34	6.81
6	300332	方邦股份	18,942,764	384,538,109.20	5.54
7	002090	美芝股份	9,999,462	272,796,363.88	3.98
8	300104	奇安信	6,102,268	249,485,461.08	3.59
9	300137	华信股份	12,849,840	207,622,342.40	2.99
10	300276	福耀玻璃	5,106,149	198,833,442.06	2.88

5.2.12 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资产支持证券投资明细

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	002193	华鲁恒升	617,521,066.26	6.89	
2	300067	东方电力	9,201,304	518,711,328.48	7.47
3	002096	伟明纸业	19,093,270	500,246,204.00	7.30
4	002488	金隅股份	24,709,546	478,129,095.76	6.88
5	002174	鑫磊股份	7,187,019	473,396,346.34	6.81
6	300332	方邦股份	18,942,764	384,538,109.20	5.54
7	002090	美芝股份	9,999,462	272,796,363.88	3.98
8	300104	奇安信	6,102,268	249,485,461.08	3.59
9	300137	华信股份	12,849,840	207,622,342.40	2.99
10	300276	福耀			