

融通深证成份指数证券投资基金

[2015]第三季度报告

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10月23日

§ 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10月20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，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。

本报告书经基金经理审阅。

本报告书自2015年7月1日起至2015年9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	207,331,049.61份

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约束和数量化的风险管理手段，力争将本基金净值增长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，以实现对深证成份指数的有效跟踪。

本基金采用完全复制法指定期指基的指数化投资策略，按照行业分类的指基中的权重重新构造指数化投资组合，并根据标的指数成分股的变化情况进行相应调整，力争实现基金净值增长率与业绩比较基准之差的绝对值不超过0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内。

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 本基金为股票型指基，属于高风险、高收益的基金品种，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

3.1 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	-841,753.87
2.本期利润	-74,744,098.22
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3569
4.期末基金份额净值	164,385,534.52
5.期末基金份额净值	0.793

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)本基金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将低于所列数字。

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① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 净值增长率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -30.44% 3.83% -28.92% 3.42% -1.52% 0.41%

3.2.2 本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

图:融通深证成份指数基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较

3.2.3 管理人报告

4.1 基金经理(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

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
李勇	本基金基金经理,融通巨潮100指数基金(LOF)基金经理,融通深证成份指数基金经理	2010年11月15日	-	11 研究生学历,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。

注:任职日期根据基金管理人对外披露的任职日期填写;证券从业年限以从事证券业务相关工作的时

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,充分保护基金份额持有人的合法权益,本基金管理符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.3 公司简介

4.3.1 公司基本情况

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、决策、交易和绩效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制度和流程。

4.3.2 公司管理的基金

4.3.3 公司的股东情况

4.3.4 公司的子公司情况

4.3.5 公司的业务范围

4.3.6 公司的内部管理机构及主要负责人情况

4.3.7 公司的基金管理情况

4.3.8 公司的基金托管情况

4.3.9 公司的监察稽核情况

4.3.10 公司的关联交易情况

4.3.11 公司的重大诉讼情况

4.3.12 公司的重大仲裁情况

4.3.13 公司的其他情况

4.4 报告期内基金运作指标

4.4.1 报告期内基金运作指标

4.4.2 报告期内基金运作指标

4.4.3 报告期内基金运作指标

4.4.4 报告期内基金运作指标

4.4.5 报告期内基金运作指标

4.4.6 报告期内基金运作指标

4.4.7 报告期内基金运作指标

4.4.8 报告期内基金运作指标

4.4.9 报告期内基金运作指标

4.4.10 报告期内基金运作指标

4.4.11 报告期内基金运作指标

4.4.12 报告期内基金运作指标

4.4.13 报告期内基金运作指标

4.4.14 报告期内基金运作指标

4.4.15 报告期内基金运作指标

4.4.16 报告期内基金运作指标

4.4.17 报告期内基金运作指标

4.4.18 报告期内基金运作指标

4.4.19 报告期内基金运作指标

4.4.20 报告期内基金运作指标

4.4.21 报告期内基金运作指标

4.4.22 报告期内基金运作指标

4.4.23 报告期内基金运作指标

4.4.24 报告期内基金运作指标

4.4.25 报告期内基金运作指标

4.4.26 报告期内基金运作指标

4.4.27 报告期内基金运作指标

4.4.28 报告期内基金运作指标

4.4.29 报告期内基金运作指标

4.4.30 报告期内基金运作指标

4.4.31 报告期内基金运作指标

4.4.32 报告期内基金运作指标

4.4.33 报告期内基金运作指标

4.4.34 报告期内基金运作指标

4.4.35 报告期内基金运作指标

4.4.36 报告期内基金运作指标

4.4.37 报告期内基金运作指标

4.4.38 报告期内基金运作指标

4.4.39 报告期内基金运作指标

4.4.40 报告期内基金运作指标

4.4.41 报告期内基金运作指标

4.4.42 报告期内基金运作指标

4.4.43 报告期内基金运作指标

4.4.44 报告期内基金运作指标

4.4.45 报告期内基金运作指标

4.4.46 报告期内基金运作指标

4.4.47 报告期内基金运作指标

4.4.48 报告期内基金运作指标

4.4.49 报告期内基金运作指标

4.4.50 报告期内基金运作指标

4.4.51 报告期内基金运作指标

4.4.52 报告期内基金运作指标

4.4.53 报告期内基金运作指标

4.4.54 报告期内基金运作指标

4.4.55 报告期内基金运作指标

4.4.56 报告期内基金运作指标

4.4.57 报告期内基金运作指标

4.4.58 报告期内基金运作指标

4.4.59 报告期内基金运作指标

4.4.60 报告期内基金运作指标

4.4.61 报告期内基金运作指标

4.4.62 报告期内基金运作指标

4.4.63 报告期内基金运作指标

4.4.64 报告期内基金运作指标

4.4.65 报告期内基金运作指标

4.4.66 报告期内基金运作指标

4.4.67 报告期内基金运作指标

4.4.68 报告期内基金运作指标

4.4.69 报告期内基金运作指标

4.4.70 报告期内基金运作指标

4.4.71 报告期内基金运作指标

4.4.72 报告期内基金运作指标

4.4.73 报告期内基金运作指标

4.4.74 报告期内基金运作指标

4.4.75 报告期内基金运作指标

4.4.76 报告期内基金运作指标

4.4.77 报告期内基金运作指标

4.4.78 报告期内基金运作指标

4.4.79 报告期内基金运作指标