

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

§ 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
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约束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数字化投资组合，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	
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	-74,744,008.22
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3569
4.期末基金资产净值	164,385,554.52
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所列数字。

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	-30.44%	3.83%	-28.92%	3.42%	-1.52%	0.41%

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



§ 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	本基金基金经理、融通100指数基金（LOF）基金经理、融通创业板指数基金基金经理	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、基金经理助理等。

注：任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》等有关法律法规和基金合同的约定，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

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数字化投资组合，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。

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-30.44%，同期业绩比较基准收益率为-28.92%。

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	149,277,634.40	90.45
2	其中：股票	149,277,634.40	90.45
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	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	其他资产	9,960,853.32	6.04
11	其他资产	5,794,017.42	3.51
12	合计	165,032,505.14	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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,592,073.00	0.97
B	采矿业	2,284,475.16	1.39
C	制造业	86,706,574.05	52.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,289,688.60	2.00
E	建筑业	2,865,826.74	1.74
F	批发和零售业	4,973,060.01	3.03
G	交通运输、仓储和邮政业	871,471.66	0.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	16,690,748.02	10.10
J	金融业	9,411,993.18	5.73
K	房地产业	8,370,819.16	5.09
L	租赁和商务服务业	4,239,349.33	2.58
M	科学研究和技术服务业	437,901.40	0.27
N	水利、环境和公共设施管理业	2,833,608.29	1.72
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	905,157.72	0.55
R	文化、体育和娱乐业	3,311,213.08	2.01
S	综合	58,5675.00	0.36
	合计	149,277,634.40	90.81

5.2.2 报告期末非指数投资按行业分类的股票投资组合

5.3 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

5.3.1 报告期末指数投资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

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	000651	格力电器	148,402	2,401,144.36	1.46
2	000001	平安银行	205,174	2,152,275.26	1.31
3	000725	京东方A	761,698	2,125,137.42	1.29
4	000024	招商地产	59,697	1,700,767.53	1.03
5	000333	美的集团	67,065	1,692,049.95	1.03
6	002183	怡亚通	38,700	1,679,193.00	1.02
7	002024	苏宁云商	133,205	1,614,444.60	0.98
8	002415	海康威视	43,227	1,408,335.66	0.86
9	000917	电广传媒	68,100	1,312,287.00	0.80
10	300104	乐视网	31,129	1,272,553.52	0.77

5.3.2 报告期末非指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

5.4.1 报告期末非指数投资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

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资产支持证券投资明细

5.6 报告期末贵金属投资明细

5.7 报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.8 报告期末基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.9 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.10 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.11 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.12 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.13 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.14 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.15 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.16 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.17 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.18 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.19 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.20 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.21 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.22 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.23 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.24 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.25 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.26 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.27 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.28 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.29 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.30 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.31 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.32 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.33 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.34 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.35 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.36 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.37 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.38 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.39 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.40 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.41 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.42 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.43 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.44 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.45 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.46 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.47 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.48 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.49 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.50 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.51 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.52 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.53 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.54 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.55 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.56 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.57 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.58 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.59 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.60 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.61 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.62 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.63 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.64 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.65 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.66 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.67 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.68 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.69 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.70 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.71 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.72 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.73 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.74 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.75 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.76 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.77 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.78 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.79 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.80 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.81 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.82 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.83 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.84 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.85 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.86 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.87 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.88 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.89 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.90 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.91 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.92 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.93 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.94 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.95 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.96 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.97 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.98 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.99 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.100 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.101 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.102 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.103 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.104 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.105 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.106 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.107 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.108 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.109 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.110 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.111 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.112 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.113 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.114 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.115 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.116 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.117 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.118 报告期末基金投资的国债期货交易情况

5.119 报告期末基金投资的国债期货交易情况