

融通通利系列证券投资基金之融通债券投资基金

2012 第三季度 报告

2012年9月30日

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:2012年10月24日

§1 重要提示

融通通利系列证券投资基金由融通债券投资基金、融通深证100指数证券投资基金和融通蓝筹成长证券投资基金共同构成...

§2 基金产品概况

Table with columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人, 下属分级基金的基金简称, 下属分级基金的基金代码, 报告期末下属分级基金的份额总额

§3 主要财务指标和基金净值表现

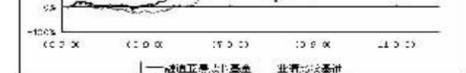
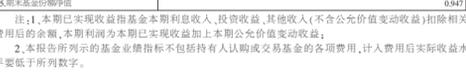
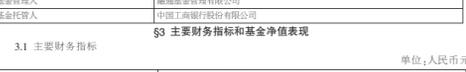
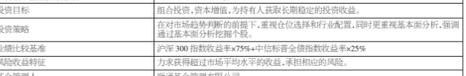
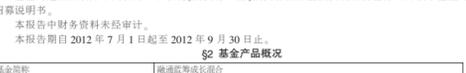
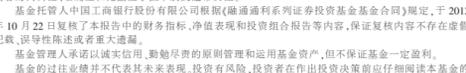
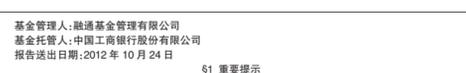
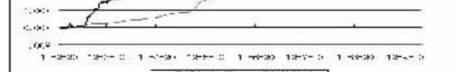
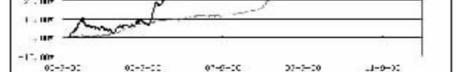
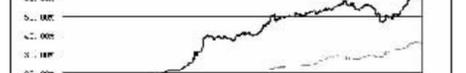
Table with columns: 基金名称, 报告期末(2012年7月1日-2012年9月30日), 本报告期末, 本报告期间, 本报告期末基金份额净值, 本报告期末基金份额净值增长率

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...

Table with columns: 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

Table with columns: 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

注:本基金业绩比较基准项目分段计算,其中:2009年12月31日(含此日)之前采用“银行间债券综合指数”...



注:本基金业绩比较基准项目分段计算,其中:2009年12月31日(含此日)之前采用“国券国债指

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵守信情况的说明
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、《融通通利系列证券投资基金合同》的规定...

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...

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
本季度宏观经济整体延续了下行的趋势,工业增加值、PMI、CPI等指标均处于低位...

4.5 报告期内基金的业绩表现
本报告期内,融通债券A/B类基金份额净值增长率为-0.10%,同期业绩比较基准收益率为0.09%...

§5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况
5.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
5.6 投资组合报告附注

5.6.1 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

5.6.2 其他资产构成

5.6.3 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.6.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

§6 开放式基金份额变动
§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录
(一)中国证监会批准融通通利系列证券投资基金设立的文件

7.2 存放地点
基金管理人、基金托管人处

7.3 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www.rtfund.com查询

融通基金管理有限公司
二〇一二年十月二十四日

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:2012年10月24日

§1 重要提示
融通通利系列证券投资基金由融通债券投资基金、融通深证100指数证券投资基金和融通蓝筹成长证券投资基金共同构成...

§2 基金产品概况
基金名称:融通债券投资基金
基金代码:161603
基金运作方式:契约型开放式

§3 主要财务指标和基金净值表现
基金名称:融通债券投资基金
报告期末(2012年7月1日-2012年9月30日)

§4 基金经理简介
姓名:张勇
职务:本基金的基金经理
任职日期:2012年8月29日

§5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况
5.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
5.6 投资组合报告附注

5.6.1 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

5.6.2 其他资产构成

5.6.3 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.6.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

§6 开放式基金份额变动
§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录
(一)中国证监会批准融通通利系列证券投资基金设立的文件

7.2 存放地点
基金管理人、基金托管人处

7.3 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www.rtfund.com查询

融通基金管理有限公司
二〇一二年十月二十四日

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:2012年10月24日

§1 重要提示
融通通利系列证券投资基金由融通债券投资基金、融通深证100指数证券投资基金和融通蓝筹成长证券投资基金共同构成...

§2 基金产品概况
基金名称:融通债券投资基金
基金代码:161603
基金运作方式:契约型开放式

§3 主要财务指标和基金净值表现
基金名称:融通债券投资基金
报告期末(2012年7月1日-2012年9月30日)

§4 基金经理简介
姓名:张勇
职务:本基金的基金经理
任职日期:2012年8月29日

§5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况
5.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

融通通利系列证券投资基金之融通深证100指数证券投资基金

2012 第三季度 报告

2012年9月30日

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:2012年10月24日

§1 重要提示

融通通利系列证券投资基金由融通债券投资基金、融通深证100指数证券投资基金和融通蓝筹成长证券投资基金共同构成...

§2 基金产品概况
基金名称:融通深证100指数证券投资基金
基金代码:161604
基金运作方式:契约型开放式

§3 主要财务指标和基金净值表现
基金名称:融通深证100指数证券投资基金
报告期末(2012年7月1日-2012年9月30日)

§4 基金经理简介
姓名:张勇
职务:本基金的基金经理
任职日期:2012年8月29日

§5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况
5.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
5.6 投资组合报告附注

5.6.1 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

5.6.2 其他资产构成

5.6.3 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.6.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

§6 开放式基金份额变动
§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录
(一)中国证监会批准融通通利系列证券投资基金设立的文件

7.2 存放地点
基金管理人、基金托管人处

7.3 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www.rtfund.com查询

融通基金管理有限公司
二〇一二年十月二十四日

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:2012年10月24日

§1 重要提示
融通通利系列证券投资基金由融通债券投资基金、融通深证100指数证券投资基金和融通蓝筹成长证券投资基金共同构成...

§2 基金产品概况
基金名称:融通深证100指数证券投资基金
基金代码:161604
基金运作方式:契约型开放式

§3 主要财务指标和基金净值表现
基金名称:融通深证100指数证券投资基金
报告期末(2012年7月1日-2012年9月30日)

§4 基金经理简介
姓名:张勇
职务:本基金的基金经理
任职日期:2012年8月29日

§5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况
5.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
5.6 投资组合报告附注

5.6.1 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

5.6.2 其他资产构成

5.6.3 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.6.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

§6 开放式基金份额变动
§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录
(一)中国证监会批准融通通利系列证券投资基金设立的文件

7.2 存放地点
基金管理人、基金托管人处

7.3 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www.rtfund.com查询

融通基金管理有限公司
二〇一二年十月二十四日

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:2012年10月24日

§1 重要提示
融通通利系列证券投资基金由融通债券投资基金、融通深证100指数证券投资基金和融通蓝筹成长证券投资基金共同构成...

§2 基金产品概况
基金名称:融通深证100指数证券投资基金
基金代码:161604
基金运作方式:契约型开放式

§3 主要财务指标和基金净值表现
基金名称:融通深证100指数证券投资基金
报告期末(2012年7月1日-2012年9月30日)

§4 基金经理简介
姓名:张勇
职务:本基金的基金经理
任职日期:2012年8月29日

§5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况
5.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
5.6 投资组合报告附注

5.6.1 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

5.6.2 其他资产构成

5.6.3 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.6.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

§6 开放式基金份额变动
§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录
(一)中国证监会批准融通通利系列证券投资基金设立的文件

7.2 存放地点
基金管理人、基金托管人处

7.3 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www.rtfund.com查询

融通基金管理有限公司
二〇一二年十月二十四日

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:2012年10月24日

§1 重要提示
融通通利系列证券投资基金由融通债券投资基金、融通深证100指数证券投资基金和融通蓝筹成长证券投资基金共同构成...

§2 基金产品概况
基金名称:融通深证100指数证券投资基金
基金代码:161604
基金运作方式:契约型开放式

§3 主要财务指标和基金净值表现
基金名称:融通深证100指数证券投资基金
报告期末(2012年7月1日-2012年9月30日)

§4 基金经理简介
姓名:张勇
职务:本基金的基金经理
任职日期:2012年8月29日

§5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况
5.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
5.6 投资组合报告附注

5.6.1 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

5.6.2 其他资产构成

5.6.3 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.6.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

§6 开放式基金份额变动
§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录
(一)中国证监会批准融通通利系列证券投资基金设立的文件

7.2 存放地点
基金管理人、基金托管人处

7.3 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www.rtfund.com查询

融通基金管理有限公司
二〇一二年十月二十四日

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:2012年10月24日

§1 重要提示
融通通利系列证券投资基金由融通债券投资基金、融通深证100指数证券投资基金和融通蓝筹成长证券投资基金共同构成...

§2 基金产品概况
基金名称:融通深证100指数证券投资基金
基金代码:161604
基金运作方式:契约型开放式

§3 主要财务指标和基金净值表现
基金名称:融通深证100指数证券投资基金
报告期末(2012年7月1日-2012年9月30日)

§4 基金经理简介
姓名:张勇
职务:本基金的基金经理
任职日期:2012年8月29日

§5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况
5.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
5.6 投资组合报告附注

5.6.1 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

5.6.2 其他资产构成