

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

2013 第二季度 报告

2013年6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:2013年7月17日

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组成。本报告为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(以下简称“本基金”)2013年第2季度报告。

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当仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中所列数据未经审计。
本报告自2013年4月1日起至2013年6月30日止。

Table with 2 columns: 基金简称, 融通深证100指数; 交易代码, 161604; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日, 2003年9月30日; 报告期末基金份额总额, 14,944,823,263.14份; 投资目标, 本基金本报告期无积极投资部分股票; 投资策略, 本基金本报告期无积极投资部分股票; 业绩比较基准, 深证100指数收益率*95%+银行同业存款利率*5%; 风险收益特征, 风险和预期收益水平高于平均水平; 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

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2013年4月1日至2013年6月30日); 1.本期已实现收益, -316,750,588.96; 2.本期利润, -1,352,158,854.91; 3.加权平均基金份额本期利润, -0.0903; 4.期末基金份额净值, 12,874,359,602.52; 5.期末基金份额净值, 0.861

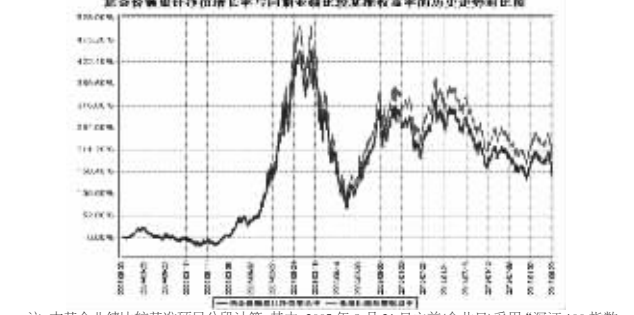
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;
2.本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 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

Table with 5 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; 过去三个月, -9.56%, 1.51%, -9.42%, 0.97%, 0.14%, 0.00%

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



注:本基金业绩比较基准自项目分段计算,其中,2005年8月21日之前(含此日)采用“深证100指数×75%+银行间债券利率×25%”,2005年8月22日起启用新基准即“深证100指数收益率×95%+银行间同业存款利率×5%”。

4 基金管理人报告

4.1 基金经理简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明; 王强, 本基金的基金经理, 融通深证100指数证券投资基金基金经理, 融通蓝筹成长证券投资基金基金经理, 融通通利系列证券投资基金基金经理, 2009年5月15日, 9, 本科学历,具有证券从业资格,2001年至2004年就职于上海市万国信息科技股份有限公司,2004年加入融通基金管理有限公司,历任基金经理、研究员、基金经理助理职务。

注: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
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,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,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。基金投资组合符合有关法律、法规和基金合同的约定。

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 报告期内本基金投资策略和运作分析
“稳增长”基金合同约定的前提下实现持有人利益的最大化是本基金管理的核心思想。并以此原则贯彻于基金运作之中。本基金运用量化投资方式,对通过控制股票投资权重与深证100指数成份股自然风险的偏离,减少仓位相对深证100指数的跟踪误差,力争最终实现沪深100指数的有效跟踪。

2013年第二季度证券市场波动较大,风格分化明显,大盘指数沪深300指数下跌11.8%,成长龙头的创业板指数上涨16.76%,从中证行业指数表现来看,传媒行业涨幅31.08%,通信行业涨幅6.75%,计算机行业涨幅5.37%,电子元器件行业涨幅2.02%,电力设备行业涨幅1.12%,而医药、钢铁、有色金属、煤炭等行业指数下跌超过15%。

4.5 报告期内基金的投资表现
本报告期基金份额净值增长率为-9.56%,同期业绩比较基准收益率为-9.42%。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

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五名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.6 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.7 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.9 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.11 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.12 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.13 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.14 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.15 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.16 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.17 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.18 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.19 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.20 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.21 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.22 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.23 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.24 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.25 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.26 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.27 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.28 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.29 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.30 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.31 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.32 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.33 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.34 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.35 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.36 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.37 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.38 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.39 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.40 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.41 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.42 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.43 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.44 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.45 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.46 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.47 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.48 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.49 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.50 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.51 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.52 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.53 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.54 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.55 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.56 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.57 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.58 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.59 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.60 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.61 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.62 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.63 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.64 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.65 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.66 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.67 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.68 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.69 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.70 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.71 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.72 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.73 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.74 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.75 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.76 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.77 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.78 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.79 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.80 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.81 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.82 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.83 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.84 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.85 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.86 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.87 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.88 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.89 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.90 报告期末前十名股票公允价值变动情况

Table with 5 columns: 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(%)

5.91 报告期末持有的处于转股