

通乾证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2013年10月25日

§1 重要提示

基金管理人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法律责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月22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,投资者在做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。

本报告自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通乾元开
交易代码	500038
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2001年8月29日
报告期末基金份额总额	2,000,000,000.00份
投资目标	本基金属于价值成长型基金,主要投资于具有一定竞争优势、业绩能够持续增长或具有增长潜力的成长型上市公司股票,同时兼做资产配置。通过主动投资,在有效分散和分散风险的前提下,谋求基金资产的稳定增长。
投资策略	以价值成长型投资为主导,把企业的内在价值和未来成长能力作为选择投资对象的核心标准。重视对趋势的判断,顺势而为,灵活运用。
业绩比较基准	无
风险收益特征	无
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2013年7月1日 - 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	24,088,167.80
2.本期利润	294,623,882.79
3.加权平均基金份额本期利润	0.1473
4.期末基金资产净值	2,356,375,830.69
5.期末基金份额净值	1.1782

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率水平要低于所列数据。

3.2 基金净值表现

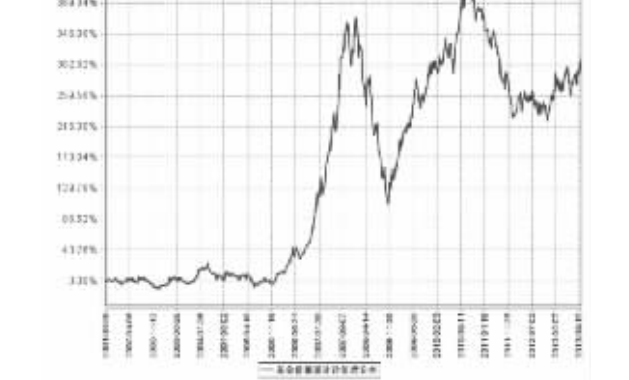
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去三个月 14.29% 2.22% - - - -

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

本基金自成立以来的基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§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	证券从业年限	说明
汪远通	本基金的基金经理、融通乾元开基金经理	2012年1月12日	17	毕业于墨尔本大学商学院,研究生学历,具有证券从业资格,1993年至1997年,在联华证券证券投资部担任经理,1997年至1999年,在联华证券有限公司证券投资部担任经理,2001年至2005年,在融通基金管理有限公司担任基金经理,2006年加入融通基金管理有限公司,历任权益部副经理和权益部助理。

注:任职日期指基金经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

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、《通乾证券投资基金合同》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,为基金持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为,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 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度A股市场在二季度反弹后反弹,沪深300指数上涨9.47%,而代表长股的企业板块涨幅35.21%,最亮丽的板块是传媒,中信一级行业中涨幅指数上涨7%,涨幅居后的是代表投资类科技如通讯、石油石化和煤炭,由于白酒板块的暴跌使食品饮料板块也处于回调后。

报告期内,本基金主要围绕整个宏观经济和市场的方向,和根本趋势,计算机等板块,对医药、大消费品也有所重视,是消费和TMT板块成为组合核心。继续大幅降低房地产、金融股投资周期股的仓位,在TMT和大消费的板块中也以上市而下的成长股为主要方向,重视大小中小公司的成长机会。

4.5 报告期内基金的投资表现

本报告期基金份额净值上涨14.29%,主要超额收益来自TMT板块的超配。

§5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,802,139,318.31	75.71
	其中:股票	1,802,139,318.31	75.71
2	固定收益投资	510,178,000.00	21.43
	其中:债券	510,178,000.00	21.43
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	45,233,195.10	1.90
6	其他资产	22,672,607.64	0.95
7	合计	2,380,221,121.05	100.00

§2 报告期末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	1,007,532,062.63	42.76
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	42,269,169.77	1.79
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	360,458,533.36	15.30
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	173,169,036.91	7.35
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	115,817,588.64	4.92
S	综合	-	-
	合计	1,802,139,318.31	76.48

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	21,321,927.00	0.90
B	采矿业	81,571,000.00	3.46
C	制造业	1,007,532,062.63	42.76
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	42,269,169.77	1.79
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	360,458,533.36	15.30
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	173,169,036.91	7.35
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	115,817,588.64	4.92
S	综合	-	-
	合计	1,802,139,318.31	76.48

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	600837	恒利股份	2,100,000	109,953,000.00	4.67
2	600887	伊利股份	2,300,135	102,770,925.40	4.36
3	000538	云南白药	800,000	93,648,000.00	3.73
4	000200	万科股份	8,921,006.91	87,921,006.91	3.73
5	400750	恒信电子	3,799,951	81,926,643.56	3.48
6	300157	恒泰艾美	4,300,000	81,571,000.00	3.46
7	002292	奥飞动漫	2,100,000	77,112,000.00	3.27
8	300079	数码视讯	2,700,100	71,741,657.00	3.04
9	002236	大华股份	1,500,014	68,370,638.12	2.90
10	002368	天振股份	1,500,024	61,140,978.24	2.59

§4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	510,178,000.00	21.65
	其中:政策性金融债	510,178,000.00	21.65
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	510,178,000.00	21.65

§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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	060201	06国开01	2,000,000	192,300,000.00	8.16
2	110234	11国开34	1,000,000	99,690,000.00	4.23
3	100236	10国开36	800,000	79,400,000.00	3.37
4	130238	13国开38	500,000	49,560,000.00	2.10
5	130421	13农发21	300,000	30,096,000.00	1.28

§6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

§7 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

本基金本报告期末未持有权证。

§8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

§8.1 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。

§8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告未持有股指期货。

§8.3 本报告期股指期货投资情况

§8.4 本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。

§8.5 本报告期国债期货投资情况

本基金本报告期末未持有国债期货。

§8.6 本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。

§8.7 本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。

§8.8 本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。

§8.9 本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。

§8.10 本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。

§8.11 本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。

§8.12 本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。

§8.13 本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。

§8.14 本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。

§8.15 本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。

§8.16 本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。

§8.17 本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。

§8.18 本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。

§8.19 本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。

§8.20 本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。

§8.21 本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。

§8.22 本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。

§8.23 本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。

§8.24 本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。

§8.25 本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。

§8.26 本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。

§8.27 本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。

§8.28 本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。

§8.29 本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。

§8.30 本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。

§8.31 本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。

§8.32 本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。

§8.33 本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。

§8.34 本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。

§8.35 本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。

§8.36 本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。

融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013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:2013年10月25日

§1 重要提示

基金管理人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法律责任。

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2013年10月22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。

本报告自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通岁岁添利定期开放债券
交易代码	161618
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年11月6日
报告期末基金份额总额	3,147,244,232.53份
投资目标	在严格控制投资风险的基础上,追求基金资产的长期稳定增值,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金主要投资于固定收益类品种,不直接买入股票、权证等权益类金融工具。本基金对预期投资组合久期与同期预期利率进行适当调整。本基金的具体投资策略包括:资产配置策略、利率策略、信用策略、类属配置与个券选择策略、可转债投资策略策略以及资产支持证券的投资策略等部分。
业绩比较基准	一年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	属于证券投资基金中的较低风险品种
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
下属各级基金的基金简称	融通岁岁添利定期开放债券A 融通岁岁添利定期开放债券B
4.期末基金资产净值	161618 161619
报告期末下属各级基金的份额总额	1,308,508,614.93份 1,838,735,617.60份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2013年7月1日 - 2013年9月30日)
--------	-----------------------------