融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31日

基金管理人:融通基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2014 年 4 月 19 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2014 年 4 月 15 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 2014 年 1 月 1 日起至 2014 年 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通标普中国可转债指数增强	
交易代码	161624	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年 3 月 26 日	
报告期末基金份额总额	130,786,174.71 份	
投资目标	本基金为增强型指数基金,对指数投资部分,采用最优复制法的投资策略,按照成份券在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份券及其权重的变化进行相应调整。本基金对主动投资部分,采取积极配置策略,利用可转债兼具债券和股票的特性,力争实现在控制基金资产下跌风险和保证投资组合流动性的基础上,为投资者获得超越业绩比较基准的稳健收益。	
投资策略	本基金为增强型指数基金,对指数投资部分,采用最优复制法的投资策略,主要以标的指数的成份券及其备选成份券构成为基础,综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合,并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及交易所可转债交易特性等情况,对投资组合进行优化调整,以保证对标的指数的有效跟踪。对主动投资部分,采取积极配置策略,力争在有效跟踪标的指数的基础上,获取超越基准的业绩表现。如果未来可转债市场出现流动性不足、券种数量下降或其它不可预见的异常情况,导致本基金无法有效对指数进行跟踪和合理配置,本基金可选择在主动投资部分适当增加对其它金融工具的投资比例,以作为对可转债投资的临时性替代。	
业绩比较基准	标普中国可转债价格指数×95%+银行活期存款利率(税后)×5%	
风险收益特征	本基金是债券型指数基金,长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金,属于较低风险、较低收益的品种。	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	融通标普中国可转债指数增强 A	融通标普中国可转债指数增强 C
下属两级基金的交易代码	161624	161625
报告期末下属两级基金的份额总额	80,649,515.68 份	50,136,659.03 份

§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(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 3 月 31 日)	
	融通标普中国可转债指数增强 A	融通标普中国可转债指数增强 C
1.本期已实现收益	-3,020,577.73	-2,034,741.07
2.本期利润	-2,228,299.88	-1,521,265.38
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0237	-0.0244
4.期末基金资产净值	72,842,049.21	45,099,726.72
5.期末基金份额净值	0.903	0.900

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

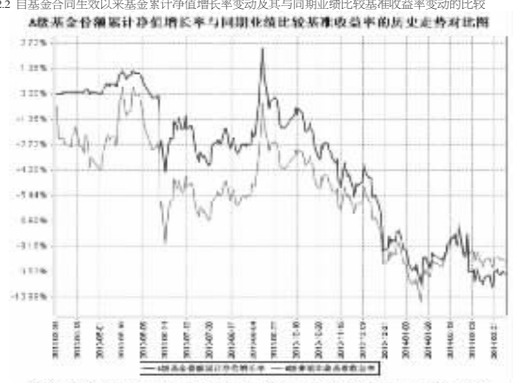
融通标普中国可转债指数增强 A

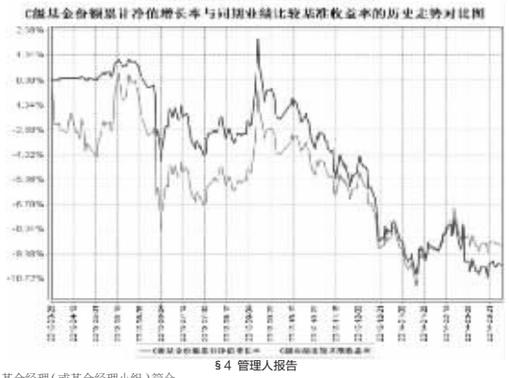
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.48%	0.54%	-0.99%	0.47%	-1.49%	0.07%

融通标普中国可转债指数增强 C

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	-2.49%	0.52%	-0.99%	0.47%	-1.50%	0.05%

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张李陵	本基金的基金经理、融通债券基金经理、融通七天理财债券基金经理	2013年 3 月 26 日	2014年 1 月 7 日	8	清华大学经济学硕士、理学学士,具有证券从业资格。2006 年 7 月至 2012 年 7 月在招商银行总行工作,主要从事债券投资和交易。2012 年 7 月加入融通基金管理有限公司。
王超	本基金的基金经理、融通债券基金经理、融通七天理财债券基金经理	2013年 12 月 27 日	-	7	金融工程硕士、经济学、数学双学士、7 年证券从业经验,具有证券从业资格。2007 年 7 月至 2012 年 8 月在深圳发展银行(现更名为平安银行)工作,主要从事债券自营交易盘投资与理财投资管理。2012 年 8 月加入融通基金管理公司任投资经理。

注:任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写;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、《融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金基金合同》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 报告期内基金投资策略和运作分析

2014 年一季度,经济增速明显下行,资金面较为宽松,债券收益率先下后上。1-2 月份,工业增加值增速大幅下滑至 8.6%,折合成环比增速仅为 0.6%;固定资产投资增速为 17.9%,较去年同期下降了 3.3 个百分点;社会消费品零售总额同比增长 11.8%,较去年同期下降了 0.5 个百分点;出口增速亦较差,2 月份出口增速同比下降 18.1%。

受经济数据大幅低于预期的影响,股票市场延续了去年四季度下跌的趋势。不过受到政府稳增长预期的影响,股市下跌幅度较 4 季度有所下降。转债受股市表现影响,继续下跌;其中民生转债受到转债下修条款意外失败的冲击,出现了大幅的下跌。

本基金在此期间根据市场表现适时灵活地调整了转债的仓位水平。

展望 2 季度,股票市场在政策托底的影响下,下跌的空间有限;而其上涨的空间将受到实际政策刺激效果的影响,从去年 3 季度的政府刺激经验来看,政策刺激的持续时间将较为短暂,因此股指上升的空间可能较小,二季度大概率将维持小幅震荡的格局。其中转债中占比较高的银行等大盘蓝筹转债,由于标的股票的估值相对较低,且转债对应的转股溢价率也处于较低水平,仍存在上涨的空间。近期,一些大盘蓝筹股大幅提高了分红比例,红利率最高的近 10%,这种提高分红比例的趋向值得关注,此举将大幅提高蓝筹股的投资吸引力从而打开转债上涨的空间。本基金在二季度将密切关注蓝筹转债的投资机会,适时提高其配置比例。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期 A 类基金份额净值增长率为 -2.48%,C 类基金份额净值增长率为 -2.49%,同期业绩比较基准为 -0.99%。

§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	4,329,100.00	3.05
	其中:股票	4,329,100.00	3.05
2	固定收益投资	128,768,350.18	90.73
	其中:债券	128,768,350.18	90.73
	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	7,438,214.05	5.24
6	其他资产	1,392,408.17	0.98
7	合计	141,928,072.40	100.00

5.2 报告期末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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	4,329,100.00	3.67
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,329,100.00	3.67

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

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	000001	平安银行	150,000	1,615,500.00	1.37
2	600036	招商银行	160,000	1,571,200.00	1.33
3	601166	兴业银行	120,000	1,142,400.00	0.97

5.4 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	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	9,741,975.84	8.26
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	119,026,374.34	100.92
8	其他	-	-
9	合计	128,768,350.18	109.18

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债券投资明细

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(%)
1	113001	中行转债	268,590	26,303,018.70	22.30
2	110015	石化转债	195,000	19,962,150.00	16.93
3	110023	民生转债	212,440	18,803,064.40	15.94
4	113002	工行转债	180,000	17,888,400.00	15.17
5	113005	平安转债	165,000	16,310,250.00	13.83

5.6 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。

5.7 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

截止本报告期末,本基金未投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	25,966.54
2	应收证券清算款	491,831.70
3	应收股利	-
4	应收利息	866,844.41
5	应收申购款	7,765.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,392,408.17

5.10.3 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	26,303,018.70	22.30
2	110015	石化转债	19,962,150.00	16.93
3	110023	民生转债	18,803,064.40	15.94
4	113002	工行转债	17,888,400.00	15.17
5	110020	南山转债	8,101,783.20	6.87
6	110018	国电转债	5,165,000.00	4.38
7	110024	隧道转债	3,309,120.00	2.81
8	110017	中海转债	21,924.00	0.02
9	113003	重工转债	17,792.20	0.02

5.10.4 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	融通标普中国可转债指数增强 A	融通标普中国可转债指数增强 C
报告期期初基金份额总额	101,935,056.59	69,748,841.69
报告期期间基金总申购份额	54,803.44	296,212.68
减:报告期期间基金总赎回份额	21,340,344.35	19,908,395.34
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	80,649,515.68	50,136,659.03

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准融融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金设立的文件

(二)《融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金基金合同》

(三)《融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金托管协议》

(四)《融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金招募说明书》

(五)融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照

(六)报告期内在指定报刊上披露的各项公告

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

8.3 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 http://www.rtfund.com 查询。

融通基金管理有限公司
二〇一四年四月十九日

融通医疗保健行业股票型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31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:2014 年 4 月 19 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 2014 年 4 月 16 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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通医疗保健股票
交易代码	161616
前端交易代码	161616
后端交易代码	161617
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年 7 月 26 日
报告期末基金份额总额	2,563,091,772.78 份
投资目标	本基金主要投资于医疗保健行业股票,在合理控制投资风险的基础上,获取基金资产的长期增值,力争实现超越业绩基准的长期收益。
投资策略	本基金主要投资于医疗保健行业股票,立足行业未来发展主要驱动力"变革与创新",把握医疗政策改革机遇,发展以药物创新为主的核心竞争力,根据"高增长+核心竞争力"的选股原则精选个股,力争获取超越业绩基准的业绩表现。
业绩比较基准	申万医药生物行业指数收益率×80% + 中信标普全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为主动股票型行业基金,属于预期风险收益水平较高的基金品种,其预期收益和风险高于混合型基金、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(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 3 月 31 日)
1.本期已实现收益	40,832,683.29
2.本期利润	-47,322,029.25
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0276
4.期末基金资产净值	2,836,783,254.81
5.期末基金份额净值	1.107

注:(1)所述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;

(2)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。

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	2.50%	1.53%	0.06%	1.11%	2.44%	0.42%

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴巍	本基金的基金经理、融通新蓝筹混合基金、融通通祥一年目标触发式混合基金的基金经理、基金管理部总监	2012年 7 月 26 日	-	21	硕士学位,21 年证券从业经验。具有证券从业资格。自 1993 年 7 月起,先后任职珠海丽珠医药集团公司药品开发工程师、中银信证券深圳研究所行业研究员、深圳市至善投资有限公司行业研究员、宝盈基金管理有限公司行业研究员,2003 年 12 月进入融通基金管理有限公司,先后任行业研究员、研究部总监、基金管理部总监。现同时任融通新蓝筹混合、融通医疗保健行业股票和融通通祥一年目标触发式混合基金经理。
蒋秀蕾	本基金的基金经理	2012年 9 月 6 日	-	7	药物化学硕士学位,具有证券从业资格。2006 年 8 月起,先后担任朗生医药(深圳)有限公司产品经理、招商证券研发中心研究员、嘉联融丰投资有限公司投资经理。2009 年 2 月加入融通基金管理有限公司,先后担任研究策划部行业研究员、行业组长。

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、《融通医疗保健行业股票型证券投资基金基金合同》,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,在授权、研究、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。

本基金管理人对报告期内不同时间窗下(日内、3 日内、5 日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析,各投资组合的同向交易价差均处于合理范围之内。

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

2014 年第一季度,经济层面继续表现出持续下滑局面,伴随着流动性的日益趋紧造成了市场风险偏好的近期调整进而造成了高风险偏好为代表的创业板回调。医药行业走势和创业板走势基本一致,行业本身平淡的年报和季报行情和行业数据(1-2 月份统计局公布行业收入利润增长 13-15%附近)是行业在 3 月份回调的主要原因。但行业 1 季度不乏亮点,医疗器械领域上市公司的连续停牌并购整合以及医疗服务领域不断的医院并购使之成为了医药行业 14 年以来最具有发展空间和增长动力的两个子行业。第一季度申万医药指数下跌 0.38%,跑赢沪深 300 指数 7.51 个百分点,整体涨幅居 23 个申万一级子行业第 9 位。

医疗保健行业基金在第一季度格遵循基金契约要求,按照资产配置预案要求,坚持"核心竞争力 + 高增长 + 主体投资"的配置思路,一季度医药行业主要体现出医疗器械和医疗服务的子板块投资机会以及医药行业创业板中小板的一些个股机会。一季度本基金对于一些医疗器械和医疗服务的优质公司的适时增持和重点持有以及传统制药类资产的低配是本基金业绩正贡献的主要原因。

展望 14 年二季度,预计中药发改委降价幅度好于市场预期,IPO 新规则后将增加市场供给扇时将严峻考验创业板的高估值水平,预计分化仍将持有,一批战略清晰、市值增长空间大、业绩高增长的公司将在反弹中率先创出新高。此外基于二季度即将开始新一轮基本药物各地招标以及下半年的医保目录扩容,降价届时也尘埃落定,我们认为医药行业下半年机会将大过于上半年。我们主要看好具有核心竞争力、业绩高增长、或拥有大品种和明确增长空间的优质医药股,主要看好医疗器械和医疗服务两个子板块。

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 2.50%,同期业绩比较基准收益率为 0.06%。

§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	2,435,726,748.35	85.15
	其中:股票	2,435,726,748.35	85.15
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	买入返售金融资产	-	-
5	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	323,537,731.19	11.31
7	其他资产	101,332,297.88	3.54
8	合计	2,860,596,777.42	100.00

5.2 报告期末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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,258,510,906.63	79.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	76,818,555.00	2.71
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	32,018,550.72	1.13
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	68,378,736.00	2.41
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,435,726,748.35	85.86

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

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	002437	誉衡药业	3,110,719	165,676,893.94	5.84
2	300003	乐普医疗	7,000,798	143,376,343.04	5.05
3	600196	复星医药	7,000,069	140,211,382.07	4.94
4	002219	恒康医疗	4,999,733	123,193,421.12	4.34
5	600594	益佰制药	3,000,070	122,852,866.50	4.33
6	300298	三诺生物	1,501,049	97,568,185.00	3.44
7	002022	科华生物	3,499,887	78,012,481.23	2.75
8	002390	信邦制药	1,600,000	76,960,000.00	2.71
9	300246	宝莱特	3,002,052	71,628,960.72	2.53
10	300030	阳普医疗	2,849,910	71,418,744.60	2.52

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,425,334.76
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	57,870.62
5	应收申购款	99,849,092.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	101,332,297.88

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300003	乐普医疗	143,376,343.04	5.05	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,413,115,429.15
报告期期间基金总申购份额	2,455,536,707.91
减:报告期期间基金总赎回份额	1,305,560,364.28
报告期期末基金份额总额	2,563,091,772.78

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.1.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准融通医疗保健行业股票型证券投资基金设立的文件

(二)《融通医疗保健行业股票型证券投资基金基金合同》

(三)《融通医疗保健行业股票型证券投资基金托管协议》

(四)《融通医疗保健行业股票型证券投资基金招募说明书》及其更新

(五)融通基金管理有限公司开放式基金业务管理规则》

(六)融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照

(七)报告期内在指定报刊上披露的各项公告

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

8.3 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
二〇一四年四月十九日

融通四季添利债券型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31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:2014 年 4 月 19 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 2014 年 4 月 16 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 2014 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通四季添利债券
基金主代码	161614
交易代码	161614
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年 3 月 1 日
报告期末基金份额总额	318,234,658.44 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。
投资策略	本基金将在基金合同约定的投资范围内,通过对宏观经济运行状况的研究,积极的调整和优化固定收益类金融工具的资产比例配置。在有效控制风险的基础上,获得基金资产的稳定增值。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金属于债券基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金、股票型基金。
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(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 3 月 31 日)
1.本期已实现收益	-9,989,188.92
2.本期利润	14,256,864.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0141
4.期末基金资产净值	317,025,192.90
5.期末基金份额净值	0.996

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。

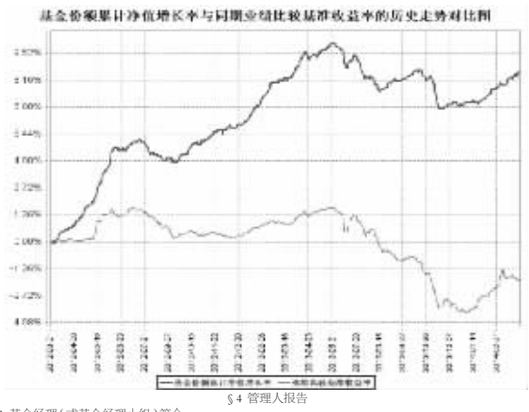
(2)本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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	1.53%	0.06%	1.61%	0.08%	-0.08%	-0.02%

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蔡奕奕	本基金的基金经理、融通易支付货币基金的基金经理、融通岁岁添利定期开放债券基金的基金经理	2012年 3 月 1 日	-	8	管理科学硕士,具有证券从业资格。2006 年 3 月至 2006 年 11 月,就职于万家基金管理有限公司,担任交易员职务,从事股票债券交易工作;2006 年 12 月至 2008 年 8 月,就职于银河基金管理有限公司,担任交易员职务,从事债券交易工作;2008 年 9 月至今,就职于融通基金管理有限公司,历任交易员、行业研究员职务。

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、《融通四季添利债券型证券投资基金基金合同》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