

融通深证成份指数证券投资基金

2014 半年度 报告摘要

2014年6月30日

市场利率也回落走稳,市场的流动性将逐渐得到改善,可见政策目前仍维持着 优化结构,托底经济”的两头抓的政策思路,经济出现大幅下跌的可能性较小,因而总体来看无需对 A 股市场过度悲观。从板块来看,经过 1 年多的结构化分化后,当前传统行业隐含的悲观预期以及新兴产业的乐观预期都体现的较为充分,在政策逐渐微调更加偏向于稳增长、防风险的背景下,传统经济将得到较强支撑,因而结构化的特征一定程度上将会变得较为缓和,同时,新兴产业板块经过 1 年的持续上涨后,整体估值已经较高,新兴产业内部也将出现分化,因而,传统板块和新兴产业都将存在机会。具体来看,传统蓝筹股在“稳增长”政策的支撑下会阶段性出现价值回归和反弹的机会,而在增长稳定的前提下,改革则将再起步;资源要素价格改革、国有企业改革、教育、医药卫生、文化、电力、油气、盐业改革将加快推进,在经济转型期,摆阔旧经济的束缚,实现新兴产业融合,金融实体经济以及混合所有制建设有望成为新的增长点;另一方面,由于“优化结构”仍是政策的主导方向,中国经济要由要素驱动转向创新驱动,产业结构将由重化工业为主升级到高端制造业和现代服务业为主,3D 打印、新能源、互联网金融和高端装备制造等仍然具有较大的增长空间。

4.6 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
报告期内,本基金估值业务严格按照《融通深证成份指数证券投资基金估值业务原则和程序》进行,公司设立由研究部、风险管理部、登记清算部、固定收益部、国际业务部和监察稽核部指定专人负责,估值委员会由基金经理、风险管理部、固定收益部、国际业务部和监察稽核部指定专人负责,估值委员会通过参考行业协会估值意见、参考第三方机构估值数据等多种或多种方式的有效结合,减少或避免估值偏差的发生。估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历,估值委员会不参与对基金所投资品种的公开信息、基金估值方法的法规等进行搜集并整理汇总,供估值委员会参考,监察稽核部负责基金估值工作的事前、事中及事后的审核工作。基金经理不参与估值决定,参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突,截至报告期末公司与外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
截至 2014 年 6 月 30 日,本基金每基金份额可供分配利润为-0.3803 元,依据基金合同的约定,本报告期末未进行利润分配。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵守法律法规情况
报告期内,本基金托管人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
报告期内,融通深证成份指数证券投资基金的管理人——融通基金管理有限公司在融通深证成份指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等方面,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的有关规定进行。本报告期末,融通深证成份指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见
本基金管理人依法对融通基金管理有限公司编制和披露的融通深证成份指数证券投资基金 2014 年半年度报告中财务信息、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表
会计主体:融通深证成份指数证券投资基金
报告截止日: 2014 年 6 月 30 日

资产	2014年6月30日	2013年12月31日
货币资金	27,270,212.83	38,760,465.73
结算备付金	-	-
存出保证金	-	28,496.84
交易性金融资产	488,776,310.60	575,942,783.61
其中:股票投资	488,776,310.60	575,942,783.61
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	9,017,104.11	8,867,632.20
应收利息	4,876.81	7,524.31
应收股利	-	-
应收申购款	22,374.99	52,216.85
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	525,123,031.99	623,609,119.59
负债和所有者权益	525,123,031.99	623,609,119.59
负债:	-	-
短期借款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	871,259.39	500,218.00
应付管理人报酬	431,352.97	541,328.41
应付托管费	86,270.57	108,265.88
应付销售服务费	-	-
应付交易费	20,316.18	39,192.91
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付股利	-	-
其他负债	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	187,492.86	180,772.21
负债合计	1,596,091.97	1,569,784.51
所有者权益:	-	-
实收基金	844,850,358.41	917,516,775.81
未分配利润	-321,324,018.39	-295,227,414.65
所有者权益合计	523,526,340.02	623,289,361.16
负债和所有者权益总计	525,123,031.99	623,609,119.59

注: 报告截止日 2014 年 6 月 30 日,基金份额净值 0.620 元,基金份额总额 844,850,358.41 份。

6.2 利润表
会计主体:融通深证成份指数证券投资基金
本报告期:2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

项目	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	49,778,432.26	-103,010,205.15
1.利息收入	112,784.91	108,275.15
其中:债券利息收入	112,784.91	108,275.15
股利收入	-	-
公允价值变动收益	-	-
其他收入	6,655.22	144,536.51
减:一、费用	3,686,790.34	5,458,210.54
1.管理人报酬	2,736,957.13	4,012,815.47
2.托管费	547,391.39	802,563.07
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	210,876.48	440,178.40
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	19,150.34	202,654.00
二、利润总额	-51,425,222.60	-106,468,415.59
减:所得税费用	-	-
四、净利润	-51,425,222.60	-106,468,415.59

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:融通深证成份指数证券投资基金
本报告期:2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

项目	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	917,516,775.81	-295,227,434.65
二、本期增减变动金额	-295,227,434.65	622,289,341.16
1.本期新增基金份额产生的基金净值变动(含利息、股利、公允价值变动)	-51,425,222.60	-51,425,222.60
2.本期基金份额交易产生的基金净值变动	-72,666,417.40	27,328,638.86
3.本期基金份额申购产生的基金净值变动	34,206,286.84	-9,005,338.84
4.本期基金份额赎回产生的基金净值变动	-220,903,052.11	50,897,271.30
5.本期基金份额持有人申购/赎回产生的基金净值变动	-66,870,670.66	36,431,852.99
6.其他	844,850,358.41	-321,324,018.39
三、期末所有者权益(基金净值)	622,289,341.16	328,809,016.51

注: 报告截止日 2014 年 6 月 30 日,基金份额净值 0.620 元,基金份额总额 844,850,358.41 份。

项目	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日
一、本期所有权益(基金净值)	1,189,108,813.41	-292,981,716.17
二、本期所有权益(基金净值)变动(含利息、股利、公允价值变动)	-106,468,415.59	-106,468,415.59
三、本期基金份额持有人申购/赎回产生的基金净值变动	-186,696,765.27	41,851,934.86
四、本期基金份额持有人申购/赎回产生的基金净值变动	34,206,286.84	-9,005,338.84
五、本期基金份额持有人申购/赎回产生的基金净值变动	-220,903,052.11	50,897,271.30
六、其他	1,002,412,048.14	-359,598,196.90
七、期末所有权益(基金净值)	1,082,612,347.84	642,813,851.24

注: 报告截止日 2014 年 6 月 30 日,基金份额净值 0.620 元,基金份额总额 844,850,358.41 份。

6.4 资产负债表
会计主体:融通深证成份指数证券投资基金
报告截止日: 2014 年 6 月 30 日

资产	2014年6月30日	2013年12月31日
货币资金	27,270,212.83	38,760,465.73
结算备付金	-	-
存出保证金	-	28,496.84
交易性金融资产	488,776,310.60	575,942,783.61
其中:股票投资	488,776,310.60	575,942,783.61
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	9,017,104.11	8,867,632.20
应收利息	4,876.81	7,524.31
应收股利	-	-
应收申购款	22,374.99	52,216.85
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	525,123,031.99	623,609,119.59
负债和所有者权益	525,123,031.99	623,609,119.59
负债:	-	-
短期借款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	871,259.39	500,218.00
应付管理人报酬	431,352.97	541,328.41
应付托管费	86,270.57	108,265.88
应付销售服务费	-	-
应付交易费	20,316.18	39,192.91
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付股利	-	-
其他负债	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	187,492.86	180,772.21
负债合计	1,596,091.97	1,569,784.51
所有者权益:	-	-
实收基金	844,850,358.41	917,516,775.81
未分配利润	-321,324,018.39	-295,227,414.65
所有者权益合计	523,526,340.02	623,289,361.16
负债和所有者权益总计	525,123,031.99	623,609,119.59

注: 报告截止日 2014 年 6 月 30 日,基金份额净值 0.620 元,基金份额总额 844,850,358.41 份。

6.5 利润表
会计主体:融通深证成份指数证券投资基金
本报告期:2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

项目	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	49,778,432.26	-103,010,205.15
1.利息收入	112,784.91	108,275.15
其中:债券利息收入	112,784.91	108,275.15
股利收入	-	-
公允价值变动收益	-	-
其他收入	6,655.22	144,536.51
减:一、费用	3,686,790.34	5,458,210.54
1.管理人报酬	2,736,957.13	4,012,815.47
2.托管费	547,391.39	802,563.07
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	210,876.48	440,178.40
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	19,150.34	202,654.00
二、利润总额	-51,425,222.60	-106,468,415.59
减:所得税费用	-	-
四、净利润	-51,425,222.60	-106,468,415.59

6.6 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:融通深证成份指数证券投资基金
本报告期:2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

项目	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	917,516,775.81	-295,227,434.65
二、本期增减变动金额	-295,227,434.65	622,289,341.16
1.本期新增基金份额产生的基金净值变动(含利息、股利、公允价值变动)	-51,425,222.60	-51,425,222.60
2.本期基金份额交易产生的基金净值变动	-72,666,417.40	27,328,638.86
3.本期基金份额申购产生的基金净值变动	34,206,286.84	-9,005,338.84
4.本期基金份额赎回产生的基金净值变动	-220,903,052.11	50,897,271.30
5.本期基金份额持有人申购/赎回产生的基金净值变动	-66,870,670.66	36,431,852.99
6.其他	844,850,358.41	-321,324,018.39
三、期末所有者权益(基金净值)	622,289,341.16	328,809,016.51

注: 报告截止日 2014 年 6 月 30 日,基金份额净值 0.620 元,基金份额总额 844,850,358.41 份。

6.7 资产负债表
会计主体:融通深证成份指数证券投资基金
报告截止日: 2014 年 6 月 30 日

资产	2014年6月30日	2013年12月31日
货币资金	27,270,212.83	38,760,465.73
结算备付金	-	-
存出保证金	-	28,496.84
交易性金融资产	488,776,310.60	575,942,783.61
其中:股票投资	488,776,310.60	575,942,783.61
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	9,017,104.11	8,867,632.20
应收利息	4,876.81	7,524.31
应收股利	-	-
应收申购款	22,374.99	52,216.85
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	525,123,031.99	623,609,119.59
负债和所有者权益	525,123,031.99	623,609,119.59
负债:	-	-
短期借款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	871,259.39	500,218.00
应付管理人报酬	431,352.97	541,328.41
应付托管费	86,270.57	108,265.88
应付销售服务费	-	-
应付交易费	20,316.18	39,192.91
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付股利	-	-
其他负债	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	187,492.86	180,772.21
负债合计	1,596,091.97	1,569,784.51
所有者权益:	-	-
实收基金	844,850,358.41	917,516,775.81
未分配利润	-321,324,018.39	-295,227,414.65
所有者权益合计	523,526,340.02	623,289,361.16
负债和所有者权益总计	525,123,031.99	623,609,119.59

注: 报告截止日 2014 年 6 月 30 日,基金份额净值 0.620 元,基金份额总额 844,850,358.41 份。

6.8 利润表
会计主体:融通深证成份指数证券投资基金
本报告期:2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

项目	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	49,778,432.26	-103,010,205.15
1.利息收入	112,784.91	108,275.15
其中:债券利息收入	112,784.91	108,275.15
股利收入	-	-
公允价值变动收益	-	-
其他收入	6,655.22	144,536.51
减:一、费用	3,686,790.34	5,458,210.54
1.管理人报酬	2,736,957.13	4,012,815.47
2.托管费	547,391.39	802,563.07
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	210,876.48	440,178.40
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	19,150.34	202,654.00
二、利润总额	-51,425,222.60	-106,468,415.59
减:所得税费用	-	-
四、净利润	-51,425,222.60	-106,468,415.59

6.9 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:融通深证成份指数证券投资基金
本报告期:2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

项目	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	917,516,775.81	-295,227,434.65
二、本期增减变动金额	-295,227,434.65	622,289,341.16
1.本期新增基金份额产生的基金净值变动(含利息、股利、公允价值变动)	-51,425,222.60	-51,425,222.60
2.本期基金份额交易产生的基金净值变动	-72,666,417.40	27,328,638.86
3.本期基金份额申购产生的基金净值变动		