

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
送出日期:2014年8月26日

8.1 重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售机构... 基金管理人、基金托管人及基金销售机构...

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
送出日期:2014年8月26日

8.1 重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售机构... 基金管理人、基金托管人及基金销售机构...

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
送出日期:2014年8月26日

8.1 重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售机构... 基金管理人、基金托管人及基金销售机构...

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
送出日期:2014年8月26日

8.1 重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售机构... 基金管理人、基金托管人及基金销售机构...

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
送出日期:2014年8月26日

8.1 重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售机构... 基金管理人、基金托管人及基金销售机构...

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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26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
送出日期:2014年8月26日

融通丰利四分法证券投资基金

2014 半年度 报告摘要

2014年6月30日

市场股市都将继续强劲的流入势头。在流动性充裕和信息低迷的情况下,进一步推动风险和债券价格上涨。主要股票价格指数如标普500及纳斯达克等都屡创新高。

在报告期内我们以审慎和稳健方式将基金资产分散投资于美国和亚太市场。这些资产的回报随市场形势而上涨,导致基金在报告期内实现正收益。

4.1.2 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1.65%,同期业绩比较基准收益率为8.70%。

4.2 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
我们认为国际金融市场在2014年下半年将继续有所改善。从宏观环境来看,美国经济逐渐恢复,通胀向长期政策目标回归,货币政策正常化之路已经开始,预计美联储在结束QE

我们继续维持低利率政策来稳固经济增长。欧洲经济增长动能还是较弱,预计欧洲央行会加大货币政策的宽松力度,减少通缩对欧元区经济带来的下行风险。日本消费税上调,货币政策仍将保持宽松。中国会继续进行经济改革,房地产和基建投资的调整仍将对经济增长造成下行压力,因此预计下半年货币政策将加大宽松力度以对冲国内调整带来的经济下行压力。

4.3 管理人对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《融通基金管理有限公司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人员共同组成的估值委员会,通过行业协会估值意见、参考独立第三方机构估值数据等多种方式进行有效结合,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,估值委员会成员不包含基金经理。

估值委员会定期对市场环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价,在发生影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况下及时修订估值方法,以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经公司总经理办公会议审批后方可实施。基金在采用投资回报或投资新品种时,应评价现有估值政策和程序的适用性。其中研究部负责定期对环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价,风险管理部负责估值方法的研究、价格的计算及复核,登记清算部进行具体的估值核算并计算每日基金净值,每日对基金净值品种的公开信息、基金会计估值方法等进行搜集并整理汇总,提供估值委员会参考,监察稽核部负责基金估值业务的事前、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。截至报告期末公司未与外部估值定价服务机构签约。

4.4 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明
截至2014年6月30日,本基金每基金份额的可供分配利润为-0.0445元,依据基金合同的约定,暂不进行利润分配。

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明
本报告期,本基金托管人在对融通丰利四分法证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他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 管理人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值管理、利润分配等情况的说明
报告期内,融通丰利四分法证券投资基金的基金管理人——融通基金管理有限公司在融通丰利四分法证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金申购赎回价格计算、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。本报告期内,融通丰利四分法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基金信息等内容真实、准确和完整发表意见
本基金托管人依法对本半年度报告中基金管理人编制和披露的融通丰利四分法证券投资基金2014年半年度报告中财务指标、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复核,以上内容真实、准确和完整。

6.1 资产负债表
会计主体:融通丰利四分法证券投资基金
报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元
资产
2014年6月30日 2013年12月31日
货币存款 9,469,812.43 23,434,137.11

负债和所有者权益
2014年6月30日 2013年12月31日
负债:
短期存款 -- --
交易性金融负债 -- --

所有者权益
2014年6月30日 2013年12月31日
实收基金 216,271,839.83 450,222,493.63
未分配利润 -1,278,809.40 -1,321,097.38

6.2 利润表
会计主体:融通丰利四分法证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元
项目 2014年1月1日至2014年6月30日 2013年2月5日至2013年6月30日
一、收入 4,897,691.03 -26,346,371.68

二、费用 3,684,953.03 6,427,739.28
三、利润总额 1,212,737.80 -32,764,109.96

四、净利润 1,212,737.80 -32,764,109.96

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:融通丰利四分法证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元
项目 2014年1月1日 2014年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值) 450,222,493.63 -13,211,097.38

二、本期基金份额申购和赎回产生的基金资产变动(含申购费、赎回费) -235,950,638.80 9,279,549.98

三、本期基金投资运作产生的基金资产变动(含公允价值变动损益、投资收益) 76,714,888.00 -3,352.03

四、本期基金份额持有人分配利润产生的基金资产变动(含红利再投资) -234,027,368.68 9,282,902.01

五、期末所有者权益(基金净值) 216,271,839.83 -1,278,809.40

6.4 本报告期末及上年度末资产状况
项目 2014年6月30日 2013年12月31日
货币存款 9,469,812.43 23,434,137.11

6.5 本报告期末及上年度末负债状况
项目 2014年6月30日 2013年12月31日
短期存款 -- --

6.6 本报告期末及上年度末所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:融通丰利四分法证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元
项目 2014年1月1日 2014年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值) 450,222,493.63 -13,211,097.38

二、本期基金份额申购和赎回产生的基金资产变动(含申购费、赎回费) -235,950,638.80 9,279,549.98

三、本期基金投资运作产生的基金资产变动(含公允价值变动损益、投资收益) 76,714,888.00 -3,352.03

四、本期基金份额持有人分配利润产生的基金资产变动(含红利再投资) -234,027,368.68 9,282,902.01

五、期末所有者权益(基金净值) 216,271,839.83 -1,278,809.40

6.7 本报告期末及上年度末资产状况
项目 2014年6月30日 2013年12月31日
货币存款 9,469,812.43 23,434,137.11

6.8 本报告期末及上年度末负债状况
项目 2014年6月30日 2013年12月31日
短期存款 -- --

6.9 本报告期末及上年度末所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:融通丰利四分法证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元
项目 2014年1月1日 2014年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值) 450,222,493.63 -13,211,097.38

二、本期基金份额申购和赎回产生的基金资产变动(含申购费、赎回费) -235,950,638.80 9,279,549.98

三、本期基金投资运作产生的基金资产变动(含公允价值变动损益、投资收益) 76,714,888.00 -3,352.03

四、本期基金份额持有人分配利润产生的基金资产变动(含红利再投资) -234,027,368.68 9,282,902.01

五、期末所有者权益(基金净值) 216,271,839.83 -1,278,809.40

6.10 本报告期末及上年度末资产状况
项目 2014年6月30日 2013年12月31日
货币存款 9,469,812.43 23,434,137.11

6.11 本报告期末及上年度末负债状况
项目 2014年6月30日 2013年12月31日
短期存款 -- --

6.12 本报告期末及上年度末所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:融通丰利四分法证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元
项目 2014年1月1日 2014年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值) 450,222,493.63 -13,211,097.38

二、本期基金份额申购和赎回产生的基金资产变动(含申购费、赎回费) -235,950,638.80 9,279,549.98

三、本期基金投资运作产生的基金资产变动(含公允价值变动损益、投资收益) 76,714,888.00 -3,352.03

四、本期基金份额持有人分配利润产生的基金资产变动(含红利再投资) -234,027,368.68 9,282,902.01

五、期末所有者权益(基金净值) 216,271,839.83 -1,278,809.40

6.13 本报告期末及上年度末资产状况
项目 2014年6月30日 2013年12月31日
货币存款 9,469,812.43 23,434,137.11

6.14 本报告期末及上年度末负债状况
项目 2014年6月30日 2013年12月31日
短期存款 -- --

6.15 本报告期末及上年度末所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:融通丰利四分法证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

注:“买入金额”是指买入股票成交金额,即成交单乘以成交数量,相关交易费用不计入。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细
金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 公司名称(英文), 证券代码, 本期累计卖出金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注:“卖出金额”是指卖出股票成交金额,即成交单乘以成交数量,相关交易费用不计入。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额
单位:人民币元

Table with columns: 买入成本/成交总额, 卖出收入/(成交)总额

注:表中“买入成本(成交)总额”及“卖出收入(成交)总额”均指成交金额,即成交单乘以成交数量,相关交易费用不计入。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合
本基金本报告期末持有债券投资

7.7 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
本基金本报告期末持有债券投资

7.8 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
本基金本报告期末持有资产支持证券

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细
本基金本报告期末未持有金融衍生品

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细
金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 基金名称, 基金类型, 运作方式, 管理人, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

注:本基金前十名持仓主要是ETF(交易所买卖基金)和ETN(交易所买卖票据),投资较分散,持仓较分散。

7.11 投资组合报告附注
7.11.1 本基金报告期内前十名证券的发行主体报告期内未被监管部门立案调查,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚。

7.11.2 本基金报告期内前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 期末其他各项资产构成
单位:人民币元

Table with columns: 序号, 名称, 金额

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票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。

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构
份额单位:份

Table with columns: 序号, 名称, 金额

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况
持有基金份额(份) 占基金总份额比例

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况
项目 持有基金份额总量的数量区间(份)

Table with columns: 项目, 持有基金份额总量的数量区间(份)

8.4 开放式基金份额变动
单位:份

Table with columns: 基金合同生效日, 2013年2月5日, 基金份额总额

8.5 重大事件揭示
10.1 基金份额持有人大会决议
本报告期,本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金经理人、基金托管人的专(籍)基金托管部门的重大人事变动
10.1 基金管理人重大人事变动

自2014年4月12日起,增聘刘冬为融通丰利四分法证券投资基金基金经理,胡允翼继续担任融通丰利四分法证券投资基金基金经理,具体内容请参阅2014年4月12日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上刊登的相关公告。

10.2 基金托管人的专(籍)基金托管部门的重大人事变动
本报告期,因中国工商银行工作需要,周月秋同志不再担任中国工商银行资产托管部总经理,在原任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金业务高级管理人员任职资格备案手续前,由副总经理王立波同志代为行使中国工商银行资产托管部总经理部分业务授权职责。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
本报告期,无涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变
本报告期,本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况
本基金聘请的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙),该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。

10.6 报告期内,本基金及高级管理人员、托管人的托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况
10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况
金额单位:人民币元

Table with columns: 券商名称, 交易单元数量, 成交金额, 占当期股票成交总额的比例, 佣金, 占当期佣金总额的比例, 备注

注:1、针对境外投资业务涉及多个海外证券市场金融产品的投资特点,在对券商的选择上,着重考察以下因素:

- (1)在全球范围内研究的综合实力;
(2)在单个国家(地区)证券市场的特色研究力量;
(3)在全球主要证券市场进行交易的便捷性和高效性。

2、券商选择的流程如下:
(1)针对券商等级评价,由国际业务部提出券商候选名单,风险管理部进行尽职调查,并提出评估报告;

(2)组合经理和交易员根据券商研究报告品质、交易执行能力等因素,定期对往来下单券商进行综合评价;

(3)评分记录归档并送国际业务部备案。
3、本基金本报告期新增 Morgan Stanley 1 个交易单元,无终止的券商交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况
金额单位:人民币元

Table with columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易, 基金交易

注:1、本基金采用全球行业分类标准(GICS)。
2、投资者欲了解本报告期内基金投资的所有股票明细,应阅读披露于基金管理人融通基金管理有限公司网站(http://www.rtfund.com)的年度报告正文。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动
7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细
金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 公司名称(英文), 证券代码, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注:1、本基金采用全球行业分类标准(GICS)。
2、投资者欲了解本报告期内基金投资的所有股票明细,应阅读披露于基金管理人融通基金管理有限公司网站(http://www.rtfund.com)的年度报告正文。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动
7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细
金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 公司名称(英文), 证券代码, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注:1、本基金采用全球行业分类标准(GICS)。
2、投资者欲了解本报告期内基金投资的所有股票明细,应阅读披露于基金管理人融通基金管理有限公司网站(http://www.rtfund.com)的年度报告正文。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动
7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细
金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 公司名称(英文), 证券代码, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注:1、本基金采用全球行业分类标准(GICS)。
2、投资者欲了解本报告期内基金投资的所有股票明细,应阅读披露于基金管理人融通基金管理有限公司网站(http://www.rtfund.com)的年度报告正文。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动
7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细
金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 公司名称(英文), 证券代码, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)