

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10月25日

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。

本报告自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称, 基金简称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日期, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人, 下属基金的投资范围, 下属基金的投资比例.

主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年7月1日-2014年9月30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.

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。

基金净值表现

Table with 2 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.

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:本基金合同生效日为2013年3月26日。

融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金

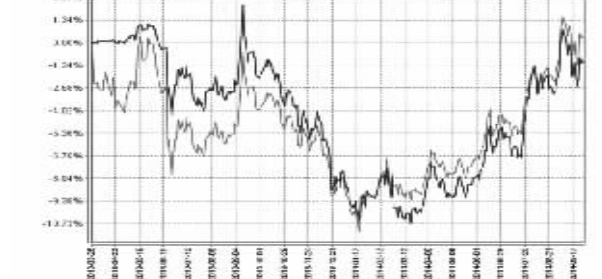
2014 第三季度 报告

2014年9月30日

基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



基金的业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:本基金合同生效日为2013年3月26日。

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时间 证券从业年限 说明

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理时间, 证券从业年限, 说明.

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,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人的利益行为,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。

基金投资策略和运作分析

2014年3季度,权益市场走势脱离了经济基本面的影响,主要受到“沪港通”政策及对改革预期的影响,市场风险情绪得到了提升,上证指数稳步上揚。

可转债由于整体债底保护较低,股性较强,基本上跟随股票市场波动。

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,适度错配了部分转债以增强收益。

展望4季度,经济复苏的道路依然曲折,8月份工业增加值大幅回升,主要的工业品价格仍在下跌,实际利率依然较高,央行在9月中旬下旬连续政策出击:1,向市场注入了5000亿SLF;2,公开市场上大幅下调了正回购利率;3,放松了房贷政策;央行此举有利于利率维持低位,并提升市场风险情绪,根据3季度股市表现来看,目前推动股市的动力并非经济基本面,更多的还在于沪港通和改革预期下的情绪推动,4季度股市有望继续上揚,本基金在4季度将密切关注转债各个券的投资机会,积极错配以提高收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现
本报告期末A类基金份额净值增长率为4.50%,C类基金份额净值增长率为4.42%,同期业绩比较基准为5.10%。

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, 投资组合, 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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

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(%)

5.6 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。

融通巨潮100 指数证券投资基金(LOF)

2014 第三季度 报告

2014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:2014年10月25日

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10月21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。

本报告自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称, 基金简称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日期, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人, 下属基金的投资范围, 下属基金的投资比例.

主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年7月1日-2014年9月30日), 融通巨潮100指数证券投资基金A, 融通巨潮100指数证券投资基金C.

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损益; (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。

基金净值表现

Table with 2 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.

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:本基金合同生效日为2009年5月15日。

基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



基金的业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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、《融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)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的利益行为,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。

融通四季添利债券型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014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:2014年10月25日

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10月21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。

本报告自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称, 基金简称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日期, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人, 下属基金的投资范围, 下属基金的投资比例.

主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年7月1日-2014年9月30日), 融通四季添利债券型证券投资基金A, 融通四季添利债券型证券投资基金C.

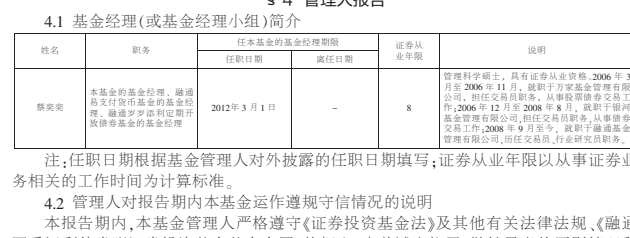
注:(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益; (2)本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

基金净值表现

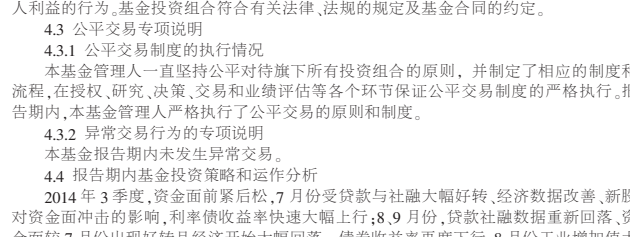
Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④.

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:本基金合同生效日为2009年9月9日。



基金的业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人的利益行为,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3季度,资金面紧张后松,7月份受贷款与社融大幅好转,经济数据改善,新股对资金面冲击的影响,利率债收益率快速大幅上揚,8,9月份,贷款社融数据重新回落,资金面较7月份好转且经济开始大幅回暖,债券收益率再度下行,8月份工业增加值大幅回升了2.1个百分点至6.9%,表明5,6月份新一轮的经济复苏基础依然较为脆弱,需要进一步宽松货币以支持经济回暖,8月份的经济数据公布后央行迅速向银行提供期限3个月规模5000亿的SLF,相当于一次全面降准,同时在公开市场上大幅下调了14天正回购利率,表明了央行意在引导货币市场利率下行以降低社会融资成本,对债券收益率下行提供了有力的支撑。

投资方面,本基金在3季度继续加强了对高资质债券品种的配置,进一步降低了低评级债券的仓位。

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
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期未投资国债期货。

5.10 报告期末股指期货投资评价
本基金本报告期未投资股指期货。

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

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.10.3 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, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.10.4 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有股票。

6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 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.

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

备查文件目录

- 8.1 备查文件目录
(一)中国证监会批准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
二〇一四年十月二十五日