融通深证成份指数证券投资基金

2014 第四季度 报告

2014年12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:2015年1月20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2015年1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10月1日起至2014年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通深证成份指数
交易代码	161612
前端交易代码	161612
后端交易代码	161662
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年11月15日
报告期末基金份额总额	659,481,179.30份
投资目标	本基金采取完全复制方法进行指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%以内,以实现对深证成份指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金,原则上采用完全复制指数的投资策略,按照成份股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股及其权重的变化进行相应调整,力争实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%的投资目标。
业绩比较基准	深证成份指数收益率×95% + 银行活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,属于高风险高收益的基金品种,其收益和风险均高于混合型基金、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10月1日 - 2014年12月31日)
1.本期已实现收益	-20,088,641.59
2.本期利润	164,224,872.75
3.加权平均基金份额本期利润	0.2292
4.期末基金资产净值	604,840,255.54
5.期末基金份额净值	0.917

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。

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	34.65%	1.55%	34.28%	1.53%	0.37%	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		
李勇	本基金基金经理、融通巨潮100指数基金(LOF)基金经理、融通创业板指数基金基金经理	2010年11月15日	-	10	研究生学历,具有证券从业资格。2005年至今就职于融通基金管理有限公司,历任金融工程研究员、基金经理助理职务。
王建强	本基金基金经理、融通深证100指数基金基金经理、融通巨潮100指数基金(LOF)基金经理、融通创业板指数基金基金经理	2010年11月15日	-	11	本科学历,具有证券从业资格。2001年至2004年就职于上海市万得信息技术股份有限公司;2004年至今就职于融通基金管理有限公司,历任金融工程研究员、基金经理助理职务。

注:1、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。

2、自2015年1月9日起,王建强先生不再担任本基金的基金经理。具体内容请参阅2015年1月9日在《上海证券报》、《中国证券报》及《证券时报》上刊登的相关公告。

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》、《融通深证成份指数证券投资基金基金基金合同》及其他有关法律法规的规定,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

本基金为被动式指数基金,原则上采用完全复制指数的投资策略,按照成份股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股及其权重的变化进行相应调整,力争实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%,年化跟踪误差控制在4%的投资目标。

2014年4季度融通深证成份指数基金上涨34.65%,同期业绩比较基准上涨34.28%。沪深300上涨44.17%,从各行业类指数的表现来看:非银金融(申万)、建筑装饰(申万)和银行(申万)领涨,电子(申万)领跌。

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34.65%,同期业绩比较基准收益率为34.28%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	574,160,302.03	94.27
	其中:股票	574,160,302.03	94.27
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	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	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	27,526,350.91	4.52
7	其他资产	7,394,692.69	1.21
8	合计	609,081,345.63	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	5,904,250.42	0.98
C	制造业	285,203,990.79	47.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,222,286.40	1.19
F	批发和零售业	16,882,515.00	2.79
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	12,436,710.66	2.06
J	金融业	133,176,669.61	22.02
K	房地产业	81,791,409.83	13.52
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	21,683,095.50	3.58
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	9,859,373.82	1.63
S	综合	-	-
	合计	574,160,302.03	94.93

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

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股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资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	000002	万 科A	4,034,391	56,078,034.90	9.27
2	000651	格力电器	1,054,421	39,140,107.52	6.47
3	000001	平安银行	2,373,542	37,596,905.28	6.22
4	000776	广发证券	1,302,100	33,789,495.00	5.59
5	000562	宏源证券	750,562	27,305,445.56	4.51
6	000783	长江证券	1,560,120	26,241,218.40	4.34
7	000333	美的集团	841,475	23,090,074.00	3.82
8	000858	五 粮 液	831,145	17,869,617.50	2.95
9	002024	苏宁云商	1,875,835	16,882,515.00	2.79
10	000625	长安汽车	932,467	15,320,432.81	2.53

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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	39,636.59
2	应收证券清算款	5,825,738.81
3	应收股利	-
4	应收利息	6,137.54
5	应收申购款	1,523,179.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,394,692.69

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

5.11.5.1 报告期末指数投资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	000562	宏源证券	27,305,445.56	4.51	吸收合并

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	778,323,879.15
报告期期间基金总申购份额	44,020,994.96
减:报告期期间基金总赎回份额	162,863,694.81
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	659,481,179.30

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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)中国证监会批准融通深证成份指数证券投资基金设立的文件

(二)《融通深证成份指数证券投资基金基金合同》

(三)《融通深证成份指数证券投资基金托管协议》

(四)《融通深证成份指数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www.rtfund.com查询。

融通基金管理有限公司
2015年1月20日

融通医疗保健行业股票型证券投资基金

2014 第四季度 报告

2014年12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:2015年1月20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2015年1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10月1日起至12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	1,923,488,961.11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,发现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10月1日 - 2014年12月31日)
1.本期已实现收益	29,159,401.33
2.本期利润	-207,823,064.80
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0965
4.期末基金资产净值	2,038,456,049.41
5.期末基金份额净值	1.060

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	-9.32%	1.38%	-0.55%	1.10%	-8.77%	0.28%

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		
蒋秀蕾	本基金的基金经理、融通健康产业基金基金经理	2012年9月6日	-	9	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。
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	2014年11月27日	21	硕士学位,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、中旅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。

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》等有关法律法规和本基金合同的规定,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年第四季度,经济数据底部企稳,在金融板块和"一带一路"带动下,大盘蓝筹持续上涨,带动指数不断上涨,而创业板表现出高位的大幅回调。医药行业方面,截止到14年11月份的行业增速相对于三季度仍然没有提升迹象,行业收入和利润增长数据(12-13%的增长水平)创下了近几年的新低,主要原因除了医保控费的压力和各省药品招标进度偏慢以外,发改委放弃医保药价权也是影响药品四季度在医院终端增长的一个主要因素。医药行业政策层面相比三季度而言维持平稳状态,行业利好和利空政策均存在,利好因素主要是医疗商业险的新政策出台以及医药电商新政策的预期,利空因素主要是医保药品定价权转移。展望15年,行业发展方向还是看好基药和非基药招标、创新药上市以及国企改革、公立医院改革和医药电商新政策等。第四季度申万医药指数下跌1.66%,大幅跑输沪深300指数达53.2个百分点,整体涨幅居28个申万一级子行业第25位。

医疗保健行业基金在四季度格遵循基金契约要求,按照资产配置预案要求,坚持"最好的医疗+最好的药"的配置思路,仓位根据市场变化寻求防守,整体思路上降低创业板股票配置比例,增加低估值蓝筹医药股配置水平,重点布局国企改革、医药电商、医疗服务和低估值蓝筹医药股。四季度医药板块在12月上旬创了历史新高以后面临持续回调,创业板医药股、小市值医药股跌幅居前,券商概念医药股、中药低估值蓝筹股涨幅居前,市场风格在四季度大幅切换。四季度本基金在寻求防守的同时,着眼于15年积极布局国企改革、医药电商和处方药领域优质低估值蓝筹股,创业板和小市值医药股回调是本基金四季度业绩大幅低于业绩比较基准的主要原因。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期内基金份额净值增长率为-9.32%,同期业绩比较基准收益率为-0.55%。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无

§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	1,835,767,599.30	85.86
	其中:股票	1,835,767,599.30	85.86
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	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	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	299,349,467.05	14.00
7	其他资产	3,031,151.52	0.14
8	合计	2,138,148,217.87	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	1,326,310,358.35	65.06
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	289,751,183.32	14.21
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	114,232,989.63	5.60
J	金融业	-	-
K	房地产业	33,096,258.00	1.62
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	72,376,810.00	3.55
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,835,767,599.30	90.06

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	600535	天士力	4,000,000	164,400,000.00	8.06
2	600587	新华医疗	4,539,990	142,237,886.70	6.98
3	600129	太极集团	7,800,000	123,162,000.00	6.04
4	600511	国药股份	3,348,937	103,783,557.63	5.09
5	000423	东阿阿胶	2,749,990	102,519,627.20	5.03
6	002007	华兰生物	2,500,092	83,253,063.60	4.08
7	000153	丰原药业	6,000,000	74,100,000.00	3.64
8	600998	九州通	4,000,033	72,280,596.31	3.55
9	300015	爱尔眼科	2,600,000	71,630,000.00	3.51
10	000919	金陵药业	5,000,000	68,000,000.00	3.34

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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	1,471,779.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	59,841.99
5	应收申购款	1,499,530.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,031,151.52

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	600129	太极集团	123,162,000.00	6.04	资产重组

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,570,769,103.85
报告期期间基金总申购份额	570,287,683.55
减:报告期期间基金总赎回份额	1,217,567,826.29
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	1,923,488,961.11

§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
二〇一五年一月二十日

融通通利系列证券投资基金之融通债券投资基金

2014 第四季度 报告

2014年12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:2015年1月20日

§1 重要提示

融通通利系列证券投资基金由融通债券投资基金、融通深证100指数证券投资基金和融通蓝筹成长证券投资基金共同构成。本报告为融通通利系列证券投资基金之子基金融通债券投资基金(以下简称"本基金")2014年第4季度报告。

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《融通通利系列证券投资基金基金合同》规定,于2015年1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10月1日起至2014年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通债券
交易代码	161603
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年9月30日
报告期末基金份额总额	307,552,276.07份
投资目标	在强调本金安全的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	以组合优化为基本策略,利用收益曲线模型和债券品种定价模型,在获取较好的稳定收益的基础上,捕捉市场出现的中短期投资机会。
业绩比较基准	中信标普全债指数收益率
风险收益特征	属于相对低风险的基金品种
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
下属两级基金的基金简称	融通债券A/B类 融通债券C类
下属两级基金的交易代码	161603 161693
下属两级基金的前端交易代码	161603 161693
下属两级基金的后端交易代码	161653 -
报告期末下属两级基金的份额总额	163,264,781.78份 144,287,494.29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10月1日 - 2014年12月31日)	
	融通债券A/B类	融通债券C类
1.本期已实现收益	4,533,828.18	4,982,072.74
2.本期利润	5,414,216.03	6,922,126.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.0209	0.0246
4.期末基金资产净值	180,909,770.06	159,154,157.37
5.期末基金份额净值	1.108	1.103

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

融通债券A/B类

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	1.74%	0.30%	3.62%	0.17%	-1.88%	0.13%

融通债券C类

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	1.66%	0.31%	3.62%	0.17%	-1.96%	0.14%

注:上表中基金业绩比较基准项目分段计算,其中:2009年12月31日(含此日)之前采用"银行间债券综合指数",2010年1月1日起使用新基准即"中信标普全债指数收益率"。

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

注:本基金A类基金份额业绩比较基准项目分段计算,其中:2009年12月31日(含此日)之前采用"银行间债券综合指数",2010年1月1日起使用新基准即"中信标普全债指数收益率"。

§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		
韩海平	本基金、融通通福分级债、融通通瑞债券、融通通泰保本混合的基金经理。	2013年12月19日	-	11	CFA,FRM,中国科学技术大学经济学硕士、管理科学和计算机科学与技术双学士,具有证券从业资格。2003年10月至2007年4月在招商基金管理有限公司工作,从事数量化投资策略研究工作;2007年5月至2012年9月在国投瑞银基金管理有限公司工作,历任高级研究员、基金经理、固定收益组副总监;2012年9月加入融通基金管理有限公司。
王超	本基金、融通标普可转债指数、融通通源短融债券、融通七天理财债券的基金经理	2013年12月27日	-	7	金融工程硕士,经济学、数学双学士,具有基金从业资格。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:任职日期和离任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

报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金合同的规定,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,本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4季度,经济增速放缓,社融规模继续下滑;央行在公开市场两次下调了正回购利率,同时继续向市场注入3个月MLF资金近3000亿,随后在11月份首次降息;宽松的资金面和疲软的经济数据共同推动债券收益率出现了大幅下行,10年国开债收益率大幅下跌至年底的4.04%水平。

投资方面,本基金在四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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,融通债券A/B类份额净值增长率为1.74%,融通债券C类份额净值增长率为1.66%,同期业绩比较基准收益率为3.62%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	478,738,461.32	92.28
	其中:债券	468,756,461.32	90.36
	资产支持证券	9,982,000.00	1.92
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	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	21,522,278.42	4.15
7	其他资产	18,524,129.04	3.57
8	合计	518,784,868.78	100.00

5.2 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