# 融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)

## 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 | 融通巨潮100指数(LOF) |
| 场内简称 | 融通巨潮 |
| 交易代码 | 161607 |
| 前端交易代码 | 161607 |
| 后端交易代码 | 161657 |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式(LOF) |
| 基金合同生效日 | 2005年5月12日 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,061,299,663.26份 |
| 投资目标 | 本基金为增强型指数基金。在控制股票投资组合相对巨潮100目标指数跟踪误差的基础上,力求获得超越巨潮100目标指数的投资收益,追求长期的资本增值。本基金谋求分享中国经济的持续、稳定增长和中国证券市场发展的成果,实现基金财产的长期增长,为投资者带来稳定的回报。 |
| 投资策略 | 本基金为增强型指数基金,在控制股票投资组合相对目标指数偏离风险的基础上,力争获得超越目标指数的投资收益。基金以指数化分散投资为主要投资策略,在此基础上进行适度的主动调整,在数量化投资技术与基本面深入研究的结合中谋求基金投资组合在偏离风险及超额收益间的最佳匹配。为控制基金偏离目标指数的风险,本基金力求将基金份额净值增长率与目标指数增长率间的日跟踪误差控制0.5%。 |
| 业绩比较基准 | 巨潮100指数收益率×95%+银行同业存款利率×5% |
| 风险收益特征 | 风险和预期收益率接近市场平均水平 |
| 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 | 48,467,026.38 |
| 2.本期利润 | 758,752,054.77 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.3733 |
| 4.期末基金资产净值 | 2,317,847,796.28 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.124 |

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。

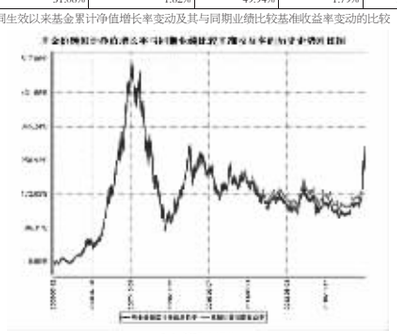
(2)本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | 51.08% | 1.82% | 49.94% | 1.79% | 1.14% | 0.03% |

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 | | |
| 王建强 | 本基金的基金经理、融通深证100指数基金基金经理、融通深证成份指数基金基金经理、融通创业板指数基金基金经理 | 2009年5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,由李勇先生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》、《证券时报》及《证券日报》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》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 报告期内基金的投资策略和运作分析

在严格遵守基金合同的前提下实现持有人利益的最大化是本基金管理的核心思想,并将此原则贯彻于基金的运作之中。本基金运用指数化投资方式,通过控制股票投资权重与巨潮100指数成份股自然权重的偏离,减少基金相对巨潮100指数基金基准的跟踪误差,力求最终实现对巨潮100指数基金基准的有效跟踪。

2014年第四季度证券市场大幅度上涨,主要得益于金融类蓝筹股的爆发性表现,大盘综合指数中沪深300指数涨44.17%。从申万行业类指数的表现来看:非银行金融涨幅116.78%,建筑涨幅67.27%、银行涨幅60.12%、房地产涨幅41.55%、交通运输涨幅38.02%;而医药、传媒、通信、轻工制造、电子元器件等行业出现下跌,成长风格的资产在四季度表现较差。

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51.08%,同期业绩比较基准收益率为49.94%。

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 | 2,204,263,627.34 | 94.22 |
| | 其中:股票 | 2,204,263,627.34 | 94.22 |
| 2 | 固定收益投资 | 70,111,000.00 | 3.00 |
| | 其中:债券 | 70,111,000.00 | 3.00 |
| | 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 | 53,606,099.10 | 2.29 |
| 7 | 其他资产 | 11,461,660.03 | 0.49 |
| 8 | 合计 | 2,339,442,386.47 | 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 | 80,722,324.61 | 3.48 |
| C | 制造业 | 519,855,127.27 | 22.43 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 57,697,834.08 | 2.49 |
| E | 建筑业 | 84,315,193.32 | 3.64 |
| F | 批发和零售业 | 26,006,352.70 | 1.12 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 33,791,920.12 | 1.46 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 48,251,631.35 | 2.08 |
| J | 金融业 | 1,214,122,534.73 | 52.38 |
| K | 房地产业 | 113,800,234.55 | 4.91 |
| 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 | 7,062,081.44 | 0.30 |
| 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 | 8,471,019.69 | 0.37 |
| S | 综合 | 10,167,373.48 | 0.44 |
| | 合计 | 2,204,263,627.34 | 95.10 |

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 | 601318 | 中国平安 | 2,133,164 | 159,368,682.44 | 6.88 |
| 2 | 600016 | 民生银行 | 9,557,694 | 103,987,710.72 | 4.49 |
| 3 | 600030 | 中信证券 | 2,789,319 | 94,557,914.10 | 4.08 |
| 4 | 600036 | 招商银行 | 5,168,041 | 85,737,800.19 | 3.70 |
| 5 | 600000 | 浦发银行 | 5,006,917 | 78,558,527.73 | 3.39 |
| 6 | 601166 | 兴业银行 | 4,695,985 | 77,483,752.50 | 3.34 |
| 7 | 600837 | 海通证券 | 3,071,602 | 73,902,744.12 | 3.19 |
| 8 | 601328 | 交通银行 | 8,461,321 | 57,536,982.80 | 2.48 |
| 9 | 000002 | 万 科A | 3,561,340 | 49,502,626.00 | 2.14 |
| 10 | 601601 | 中国太保 | 1,425,558 | 46,045,523.40 | 1.99 |

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

| 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 | 70,111,000.00 | 3.02 |
| | 其中:政策性金融债 | 70,111,000.00 | 3.02 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 70,111,000.00 | 3.02 |

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

| 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 | 140207 | 14国开07 | 400,000 | 40,060,000.00 | 1.73 |
| 2 | 140430 | 14农发30 | 300,000 | 30,051,000.00 | 1.30 |

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

本基金本报告期未投资股指期货。

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

本基金本报告期未投资国债期货。

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

本基金本报告期未投资国债期货。

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、处罚的。

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 | 151,365.78 |
| 2 | 应收证券清算款 | 5,143,854.06 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,424,443.86 |
| 5 | 应收申购款 | 3,741,996.33 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 11,461,660.03 |

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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 | 2,109,750,109.82 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 283,372,413.67 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 331,822,860.23 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 2,061,299,663.26 |

### §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巨潮100指数证券投资基金(LOF)设立的文件

(二)《融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)基金合同》

(三)《融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)托管协议》

(四)《融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)招募说明书》及其更新

(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、深圳证券交易所

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**
2015年1月20日

# 融通动力先锋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。

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 | 融通动力先锋股票 |
| 交易代码 | 161609 |
| 前端交易代码 | 161609 |
| 后端交易代码 | 161659 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2006年11月15日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,649,056,108.88份 |
| 投资目标 | 本基金为主动式股票型基金,主要投资于制造业和服务行业中价值暂时被市场低估的股票,分享中国工业化深化过程中两大推动经济增长的引擎——"制造业(特别是装备制造业)和服务业(特别是现代服务业)"的高速成长,力争在控制风险并保持良好流动性的前提下,追求稳定的、优于业绩基准的回报,为投资者实现基金资产稳定且丰厚的长期资本增值。 |
| 投资策略 | 价值低估和业绩增长是推动股价上涨的核心动力。在股价波动与上市公司基本面相关性日益密切的资本市场上,投资于推动经济增长的主要产业部门,可分享该产业部门成长性持续优于经济整体水平而获得的较为显著的超额收益。我们相信,在中国工业化深化阶段,作为经济主要推动力的制造业(特别是装备制造业)和服务业(特别是现代服务业),将是高速发展的产业领域,其增长速度将持续高于GDP增长速度。这两个行业中的价值成长型上市公司兼具良好的盈利性和成长性,长期成长前景良好,代表着中国经济增长的方向,是推动经济增长的中坚力量。本基金通过投资于制造业和服务业两大领域中价值暂时被市场低估的股票,分享中国经济和资本市场高速成长硕果,以获取丰厚的资产增值机会。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20% |
| 风险收益特征 | 属高风险高收益产品 |
| 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 | 538,347,007.59 |
| 2.本期利润 | 457,451,839.19 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.3079 |
| 4.期末基金资产净值 | 2,717,853,279.81 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.648 |

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。

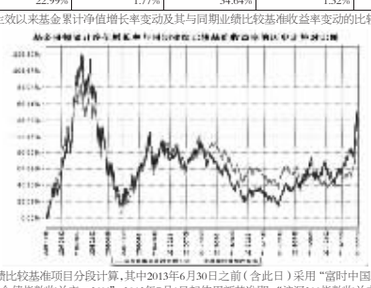
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | 22.99% | 1.77% | 34.64% | 1.32% | -11.65% | 0.45% |

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:上表中基金业绩比较基准项目分段计算,其中2013年6月30日之前(含此日)采用"富时中国A600指数收益率×80%+新华巴克莱资本中国全债指数收益率×20%",2013年7月1日起使用新基准即"沪深300指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%"。

### §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 | | |
| 丁经纬 | 本基金基金经理,融通通泽灵活配置混合基金基金经理 | 2014年8月21日 | - | 6 | 工学硕士,具有基金从业资格。2003年3月至2008年6月在浙江国华浙能发电有限公司工作,任技术主管;2008年7月至2009年7月在元大证券(香港)有限公司上海代表处工作,任行业分析师;2009年8月至2011年5月在新华基金管理有限公司工作,任行业分析师。2011年5月加入融通基金管理公司,历任投资经理助理、投资经理。 |

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

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度,市场风格较今年前三个季度发生了明显切换,以大金融和大基建为代表的蓝筹股出现快速上涨,并带动上证综数从2400点附近一路飙升至年底3234点,与之形成鲜明反差的是,创业板指数由上季度末的1541点下跌4.5%,跌至1471点收盘。由于市场二八风格分化明显,场内参与者的感受可谓五味杂陈,相当数量投资者明显感觉赚了指数没赚钱,市场上也充满了满仓踏空,牛市亏钱的声音。

报告期内,本基金顺利完成了组合结构从成长股向蓝筹股的切换,重点配置了银行、非银金融、以及基建三个方向,组合结构调整效果明显。全季度本基金上涨24.75%,虽然落后基准10.29%,但基本把握住了此轮行情的主线,跟住了主板指数飙涨的节奏。

展望下个季度,我们认为短期内A股市场惯性向上已是共识,需要讨论的是上涨的节奏和方向,我们继续看好改革预期下的大蓝筹估值修复机会,同时我们也还会坚持之前的自下而上,独立研究,优选成长股的风格,力争新的一年为投资者创造更好的收益。

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22.99%,同期业绩比较基准收益率为34.64%。

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 | 2,571,446,381.49 | 93.68 |
| | 其中:股票 | 2,571,446,381.49 | 93.68 |
| 2 | 固定收益投资 | 102,752,404.20 | 3.74 |
| | 其中:债券 | 102,752,404.20 | 3.74 |
| | 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 | 54,809,739.37 | 2.00 |
| 7 | 其他资产 | 15,782,369.26 | 0.57 |
| 8 | 合计 | 2,744,790,894.32 | 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 | 2,938,000.00 | 0.11 |
| C | 制造业 | 487,411,934.97 | 17.93 |
| 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 | 335,086,488.10 | 12.33 |
| J | 金融业 | 1,569,386,057.49 | 57.74 |
| K | 房地产业 | 164,539,527.33 | 6.05 |
| 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 | 12,084,373.60 | 0.44 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 2,571,446,381.49 | 94.61 |

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 | 600030 | 中信证券 | 7,000,000 | 237,300,000.00 | 8.73 |
| 2 | 600837 | 海通证券 | 9,599,792 | 230,970,995.52 | 8.50 |
| 3 | 600577 | 精达股份 | 31,673,686 | 224,566,433.74 | 8.26 |
| 4 | 600016 | 民生银行 | 16,999,819 | 184,958,030.72 | 6.81 |
| 5 | 002657 | 中科金财 | 3,507,246 | 166,559,112.54 | 6.13 |
| 6 | 000547 | 闽福发A | 11,911,502 | 159,852,356.84 | 5.88 |
| 7 | 600570 | 恒生电子 | 2,799,857 | 153,320,169.32 | 5.64 |
| 8 | 000712 | 锦龙股份 | 5,109,805 | 138,986,696.00 | 5.11 |
| 9 | 600999 | 招商证券 | 4,499,985 | 127,214,575.95 | 4.68 |
| 10 | 601555 | 东吴证券 | 3,999,905 | 89,677,870.10 | 3.30 |

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 | 100,045,000.00 | 3.68 |
| | 其中:政策性金融债 | 100,045,000.00 | 3.68 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 2,707,404.20 | 0.10 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 102,752,404.20 | 3.78 |

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

| 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 | 140213 | 14国开13 | 700,000 | 70,000,000.00 | 2.58 |
| 2 | 140207 | 14国开07 | 300,000 | 30,045,000.00 | 1.11 |
| 3 | 110022 | 同仁转债 | 19,010 | 2,707,404.20 | 0.10 |

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

本基金本报告期未投资股指期货。

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

本基金本报告期未投资国债期货。

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

本基金本报告期未投资国债期货。

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、处罚的情况。

2014年5月26日,东吴证券公告称公司收到中国证券监督管理委员会《关于对东吴证券股份有限公司采取出具警示函监管措施的决定》([2014]17号)(以下简称"决定"),因公司在承销上海良信电器项目过程中,资本市场部的杨庆林、池梁在询价敏感时间段与某个人投资者电话联系,该投资者实际控制的投资产品参与报价并获得配售。根据《证券公司监督管理条例》、《证券发行与承销管理办法》的有关规定,中国证监会对公司采取出具警示函的监管措施。

收到上述《决定》后,公司高度重视,并将进一步加强内部管理,严肃问责,完善相关工作程序,有效防范风险。

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 | 1,519,420.94 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,684,403.11 |
| 5 | 应收申购款 | 11,578,545.21 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 15,782,369.26 |

5.11.4 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 | 110022 | 同仁转债 | 2,707,404.20 | 0.10 |

5.11.5 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不存在流通受限情况。

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,418,374,724.26 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 403,637,296.14 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 172,955,911.52 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 1,649,056,108.88 |

### §7 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。

### §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动力先锋股票型证券投资基金设立的文件

(二)《融通动力先锋股票型证券投资基金基金合同》

(三)《融通动力先锋股票型证券投资基金托管协议》

(四)《融通动力先锋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

基金管理人处、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**
**二〇一五年一月二十日**

# 融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金

## 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。

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 | 融通岁岁添利定期开放债券 |
| 交易代码 | 161618 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2012年11月6日 |
| 报告期末基金份额总额 | 226,967,446.28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,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。 |
| 投资策略 | 本基金主要投资于固定收益类品种,不直接买入股票、权证等权益类金融工具。本基金封闭期的投资组合久期与封闭期剩余期限进行适当匹配。本基金的具体投资策略包括资产配置策略、利率策略、信用策略、类属配置与个券选择策略、可转换债券投资策略以及资产支持证券的投资策略等部分。 |
| 业绩比较基准 | 一年期银行定期存款税后收益率 |
| 风险收益特征 | 属于证券投资基金中的较低风险品种 |
| 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 | 融通岁岁添利定期开放债券A类 / 融通岁岁添利定期开放债券B类 |
| 下属两级基金的交易代码 | 161618 / 161619 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 156,025,570.26份 / 70,941,876.02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) | |
|---|---|---|
| | 融通岁岁添利定期开放债券A类 | 融通岁岁添利定期开放债券B类 |
| 1. 本期已实现收益 | 9,376,177.88 | 6,597,976.78 |
| 2. 本期利润 | 6,278,791.81 | 4,417,797.75 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0311 | 0.0356 |
| 4. 期末基金资产净值 | 164,211,949.22 | 74,639,419.49 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.052 | 1.052 |

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

融通岁岁添利定期开放债券A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 | 1.73% | 0.21% | 0.73% | 0.01% | 1.00% | 0.20% |

融通岁岁添利定期开放债券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 | 1.64% | 0.21% | 0.73% | 0.01% | 0.91% | 0.20% |

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、融通四季添利债券基金的基金经理 | 2012年11月6日 | - | 9 | 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:1、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。

2、自2014年10月10日,本基金的基金经理蔡奕奕女士因个人原因(休产假)起暂离工作岗位,经公司研究决定,蔡奕奕休产假期间,基金经理相关职责由本公司基金经理王超代为履行。具体内容请参阅2014年10月11日在《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》及《证券日报》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

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