

## 融通七天理财债券型证券投资基金

### 2015 第一季度 报告

2015年3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4月22日

**5.1 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4月17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2015年1月1日起至3月31日止。

| 基金简称            |  | 融通七天理财债券   |  |
|-----------------|--|------------|--|
| 交易代码            | 161622   |            |  |
| 基金运作方式          | 契约型开放式   |            |  |
| 基金合同生效日         | 2013年3月14日   |            |  |
| 报告期末基金份额总额      | 11,734,463.95份   |            |  |
| 投资目标            | 在严格控制投资风险和保持资产流动性的前提下,追求稳定的当期收益,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资产。本基金采取自上而下的投资分析方法,在有效控制资产组合风险的前提下,跟踪宏观经济政策取向,对收益率曲线的变动进行分析和预测,在此基础上,综合运用各种投资策略,以稳健的投资策略,本基金具体投资策略包括:利率预期和资产配置策略、信用策略、久期控制策略和流动性管理策略,适时与套利策略等部分。 |            |  |
| 业绩比较基准          | 七天通知存款税后利率。  |            |  |
| 风险收益特征          | 本基金为债券型基金,预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金,属于中低风险基金。   |            |  |
| 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   |            |  |
| 下属分级基金的基金简称     | 融通七天理财债券 A   | 融通七天理财债券 B |  |
| 下属分级基金的交易代码     | 161622   | 161623     |  |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 11,734,463.95份   | 0.00份      |  |

| 3.1 主要财务指标  |               |                           |      | 3.2 主要财务指标和基金净值表现 |  |            |  |
|-------------|---------------|---------------------------|------|-------------------|--|------------|--|
| 单位:人民币元     |               |                           |      | 单位:人民币元           |  |            |  |
| 主要财务指标      |               | 报告期(2015年1月1日至2015年3月31日) |      | 融通七天理财债券 A        |  | 融通七天理财债券 B |  |
| 1. 本期已实现收益  | 69,817.08     | 137,105.14                |      |                   |  |            |  |
| 2. 本期利润     | 69,817.08     | 137,105.14                |      |                   |  |            |  |
| 3. 期末基金资产净值 | 11,734,463.95 | 117,105.14                | 0.00 |                   |  |            |  |

| 3.2 基金净值表现                           |         |           |            |               |          |         |  |
|--------------------------------------|---------|-----------|------------|---------------|----------|---------|--|
| 3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较 |         |           |            |               |          |         |  |
| 融通七天理财债券 A                           |         |           |            |               |          |         |  |
| 阶段                                   | 净值收益率①  | 净值收益率标准差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                                | 0.4568% | 0.0039%   | 0.3239%    | 0.0009%       | 0.1299%  | 0.0034% |  |
| 融通七天理财债券 B                           |         |           |            |               |          |         |  |
| 阶段                                   | 净值收益率①  | 净值收益率标准差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                                | 0.2189% | 0.0044%   | 0.3239%    | 0.0009%       | -0.1149% | 0.0044% |  |

| 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较 |           |               |              |    |           |               |              |
|---|-----------|---------------|--------------|----|-----------|---------------|--------------|
| 序号  | 项目        | 金额(元)         | 占基金总资产的比例(%) | 序号 | 项目        | 金额(元)         | 占基金总资产的比例(%) |
| 1   | 银行存款      | -             | -            | 1  | 银行存款      | -             | -            |
| 2   | 央行票据      | -             | -            | 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3   | 金融债券      | 10,009,283.43 | 85.30        | 3  | 金融债券      | 10,009,283.43 | 85.30        |
| 4   | 其中:政策性金融债 | 10,009,283.43 | 85.30        | 4  | 其中:政策性金融债 | 10,009,283.43 | 85.30        |
| 5   | 企业债券      | -             | -            | 5  | 企业债券      | -             | -            |
| 6   | 中期票据      | -             | -            | 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7   | 其他        | -             | -            | 7  | 其他        | -             | -            |
| 8   | 合计        | 10,009,283.43 | 85.30        | 8  | 合计        | 10,009,283.43 | 85.30        |

| 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   |  |  |  |
| 王超                  | 本基金基金经理、融通蓝筹成长基金经理、融通趋势基金经理、融通红利基金经理 | 2014年1月2日   | 8      | 金融工程硕士,经济学、数学学士,具有基金从业资格,2007年7月至2012年8月在深交所发展银行任更名基金事业部主任,2012年8月加入融通基金管理有限公司,任基金经理,2012年8月加入融通基金管理有限公司,任基金经理。  |  |  |  |
| 王涛                  | 本基金的基金经理、融通蓝筹成长基金经理、融通红利基金经理         | 2015年1月6日   | 11     | 经济学硕士,具有基金从业资格,2003年7月至2007年7月在中国工商银行总行工作,任主任助理,2007年7月至2013年1月,在招商局总行工作,从事固定收益证券投资管理工作,2013年1月至2014年9月,在东吴证券工作,任固定收益部基金经理,2014年9月,加入融通基金管理有限公司,任基金经理。 |  |  |  |

注:任职日期指基金经理对外披露的任职日期,任职年限以中国证监会核准从事基金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》等有关法律法规及基金合同的规定,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  
本基金管理人一贯严格执行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  
报告期内,本基金管理人未发生异常交易。

| 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   |  |  |  |
| 王超                  | 本基金基金经理、融通蓝筹成长基金经理、融通趋势基金经理、融通红利基金经理 | 2014年1月2日   | 8      | 金融工程硕士,经济学、数学学士,具有基金从业资格,2007年7月至2012年8月在深交所发展银行任更名基金事业部主任,2012年8月加入融通基金管理有限公司,任基金经理,2012年8月加入融通基金管理有限公司,任基金经理。  |  |  |  |
| 王涛                  | 本基金的基金经理、融通蓝筹成长基金经理、融通红利基金经理         | 2015年1月6日   | 11     | 经济学硕士,具有基金从业资格,2003年7月至2007年7月在中国工商银行总行工作,任主任助理,2007年7月至2013年1月,在招商局总行工作,从事固定收益证券投资管理工作,2013年1月至2014年9月,在东吴证券工作,任固定收益部基金经理,2014年9月,加入融通基金管理有限公司,任基金经理。 |  |  |  |

| 3.1 主要财务指标      |                |                           |  |                 |  |                 |  | 3.2 主要财务指标和基金净值表现 |  |                           |  |                 |  |                 |  |
|-----------------|----------------|---------------------------|--|-----------------|--|-----------------|--|-------------------|--|---------------------------|--|-----------------|--|-----------------|--|
| 单位:人民币元         |                |                           |  |                 |  |                 |  | 单位:人民币元           |  |                           |  |                 |  |                 |  |
| 主要财务指标          |                | 报告期(2015年1月1日至2015年3月31日) |  | 融通岁添利定期开放债券 A 类 |  | 融通岁添利定期开放债券 B 类 |  | 主要财务指标            |  | 报告期(2015年1月1日至2015年3月31日) |  | 融通岁添利定期开放债券 A 类 |  | 融通岁添利定期开放债券 B 类 |  |
| 1. 本期已实现收益      | 2,549,927.36   | 1,092,733.68              |  |                 |  |                 |  |                   |  |                           |  |                 |  |                 |  |
| 2. 本期利润         | 3,835,526.59   | 1,677,491.20              |  |                 |  |                 |  |                   |  |                           |  |                 |  |                 |  |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0246         | 0.0236                    |  |                 |  |                 |  |                   |  |                           |  |                 |  |                 |  |
| 4. 期末基金资产净值     | 168,047,475.81 | 76,316,910.69             |  |                 |  |                 |  |                   |  |                           |  |                 |  |                 |  |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.077          | 1.076                     |  |                 |  |                 |  |                   |  |                           |  |                 |  |                 |  |

| 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                                | 2.38%  | 0.13%     | 0.66%      | 0.01%         | 1.72% | 0.12% |  |
| 融通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                                | 2.28%  | 0.12%     | 0.66%      | 0.01%         | 1.62% | 0.11% |  |

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

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析  
2015年一季度以来,市场波动加剧,走出波动行情,年初以来宏观经济走势继续偏弱,外汇占款减少,人民币贬值,央行降准降息,继续使定向宽松的货币政策以及下调了公开市场操作的利率,不断为市场注入流动性,但市场资金面依然偏紧,股市市场回暖,新股发行以及季末等时点资金紧张,一季度度债券市场收益率下行,整体有企稳迹象,债券市场收益率下行,收益曲线继续平缓化。  
4.4.2 报告期内基金业绩表现说明  
本报告期 A 类基金份额净值收益率为 0.4568%,B 类基金份额净值收益率为 0.2189%,同期业绩比较基准收益率为 0.3239%。  
4.5 管理人对外披露经济、证券市场及行业走势的简要展望  
一季度宏观经济企稳的弱复苏,流动性宽松程度不减,市场利率没有下降甚至有上升高企,短期债券收益率目前也基本回到年初水平,货币政策的宽松仍值得期待,高等级短融品种息差优势较为明显,有配置价值,利用新股及季末等时点积极配置存款,适时回购以及短债等。  
4.6 本报告期末,本基金未发生超标情况。  
截止本报告期末,本基金存在连续二十个工作日以上基金资产净值低于五千万元的情形。  
5.5 投资组合报告

| 序号 | 项目           | 金额(元)         | 占基金总资产的比例(%) |
|----|--------------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资         | 10,009,283.43 | 84.44        |
|    | 其中:股票        | 10,009,283.43 | 84.44        |
| 2  | 买入返售金融资产     | -             | -            |
|    | 其中:买入返售金融资产  | -             | -            |
| 3  | 银行存款和结算备付金合计 | 1,473,694.26  | 12.43        |
| 4  | 其他资产         | 371,304.03    | 3.13         |
| 5  | 合计           | 11,854,281.72 | 100.00       |

| 序号 | 项目                      | 占基金资产净值的比例(%) |
|----|-------------------------|---------------|
| 1  | 报告期内债券回购融资余额            | 0.00          |
|    | 其中:买断式回购融资              | 0.00          |
| 2  | 报告期内债券正回购融入资金余额         | -             |
| 3  | 报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例(%) | -             |

| 序号 | 项目                      | 金额 | 占基金资产净值的比例(%) |
|----|-------------------------|----|---------------|
| 1  | 报告期内债券回购融资余额            | -  | -             |
| 2  | 报告期内债券正回购融入资金余额         | -  | -             |
| 3  | 报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例(%) | -  | -             |

| 5.1 投资组合平均剩余期限基本情况 |                   |    |              |    |              |    |                   |
|--------------------|-------------------|----|--------------|----|--------------|----|-------------------|
| 序号                 | 项目                | 金额 | 占基金总资产的比例(%) | 天数 | 占基金总资产的比例(%) | 序号 | 项目                |
| 1                  | 报告期内投资组合平均剩余期限    | 88 |              | 88 |              | 1  | 报告期内投资组合平均剩余期限    |
| 2                  | 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 88 |              | 88 |              | 2  | 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 |
| 3                  | 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 1  |              | 1  |              | 3  | 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 |

| 5.2 投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明 |                        |    |              |              |              |              |              |
|----------------------------|------------------------|----|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| 序号                         | 项目                     | 金额 | 占基金总资产的比例(%) | 占基金总资产的比例(%) | 占基金总资产的比例(%) | 占基金总资产的比例(%) | 占基金总资产的比例(%) |
| 1                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | 12.56        |              |              |              |
| 2                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | -            |              |              |              |
| 3                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | -            |              |              |              |
| 4                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | 85.30        |              |              |              |
| 5                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | -            |              |              |              |
| 6                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | -            |              |              |              |
| 7                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | -            |              |              |              |
| 8                          | 合计                     | -  | -            | 97.86        |              |              |              |

| 5.3 投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明 |                        |    |              |              |              |              |              |
|----------------------------|------------------------|----|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| 序号                         | 项目                     | 金额 | 占基金总资产的比例(%) | 占基金总资产的比例(%) | 占基金总资产的比例(%) | 占基金总资产的比例(%) | 占基金总资产的比例(%) |
| 1                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | 12.56        |              |              |              |
| 2                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | -            |              |              |              |
| 3                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | -            |              |              |              |
| 4                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | 85.30        |              |              |              |
| 5                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | -            |              |              |              |
| 6                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | -            |              |              |              |
| 7                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | -            |              |              |              |
| 8                          | 合计                     | -  | -            | 97.86        |              |              |              |

| 5.4 投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明 |                        |    |              |              |              |              |              |
|----------------------------|------------------------|----|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| 序号                         | 项目                     | 金额 | 占基金总资产的比例(%) | 占基金总资产的比例(%) | 占基金总资产的比例(%) | 占基金总资产的比例(%) | 占基金总资产的比例(%) |
| 1                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | 12.56        |              |              |              |
| 2                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | -            |              |              |              |
| 3                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | -            |              |              |              |
| 4                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | 85.30        |              |              |              |
| 5                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | -            |              |              |              |
| 6                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | -            |              |              |              |
| 7                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | -            |              |              |              |
| 8                          | 合计                     | -  | -            | 97.86        |              |              |              |

| 5.5 投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明 |                        |    |              |              |              |              |              |
|----------------------------|------------------------|----|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| 序号                         | 项目                     | 金额 | 占基金总资产的比例(%) | 占基金总资产的比例(%) | 占基金总资产的比例(%) | 占基金总资产的比例(%) | 占基金总资产的比例(%) |
| 1                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | 12.56        |              |              |              |
| 2                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | -            |              |              |              |
| 3                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | -            |              |              |              |
| 4                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | 85.30        |              |              |              |
| 5                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | -            |              |              |              |
| 6                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | -            |              |              |              |
| 7                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | -            |              |              |              |
| 8                          | 合计                     | -  | -            | 97.86        |              |              |              |

| 5.6 投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明 |                        |    |              |              |              |              |              |
|----------------------------|------------------------|----|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| 序号                         | 项目                     | 金额 | 占基金总资产的比例(%) | 占基金总资产的比例(%) | 占基金总资产的比例(%) | 占基金总资产的比例(%) | 占基金总资产的比例(%) |
| 1                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | 12.56        |              |              |              |
| 2                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | -            |              |              |              |
| 3                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | -            |              |              |              |
| 4                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | 85.30        |              |              |              |
| 5                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | -            |              |              |              |
| 6                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | -            |              |              |              |
| 7                          | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -  | -            | -            |              |              |              |
| 8                          | 合计                     | -  | -            | 97.86        |              |              |              |

注:任职日期和离任日期指基金管理人对外披露的任职日期,任职年限以中国证监会核准从事基金业务相关工作的时间为计算标准。

## 融通深证成份指数证券投资基金

### 2015 第一季度 报告

2015年3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4月22日

**5.1 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4月17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2015年1月1日起至2015年3月31日止。  
5.2 基金产品概况

| 基金名称       |  | 融通深证成份指数 |  |
|------------|--|----------|--|
| 交易代码       | 161612   |          |  |
| 前缀交易代码     | 161612   |          |  |
| 后缀交易代码     | 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 | 620,210,084.25份  |          |  |
| 投资目标       | 本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现,通过严格的投资组合约束和量化的风险管理手段,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%以内,以求实现跟踪标的指数的有效跟踪。                 |          |  |
| 投资标的       | 深证成份指数收益率*95%+银行活期存款利率*5%  |          |  |
| 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权重进行配置,并根据标的指数成份股及其权重变化进行相应调整,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     | 本基金为被动式指数基金,跟踪沪深 300 指数,其风险和收益均高于混合型基金、债券型基金和货币型基金。  |          |  |
| 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   |          |  |

| 3.1 主要财务指标      |                |                           |  | 3.2 主要财务指标和基金净值表现 |  |                           |  |
|-----------------|----------------|---------------------------|--|-------------------|--|---------------------------|--|
| 单位:人民币元         |                |                           |  | 单位:人民币元           |  |                           |  |
| 主要财务指标          |                | 报告期(2015年1月1日至2015年3月31日) |  | 主要财务指标            |  | 报告期(2015年1月1日至2015年3月31日) |  |
| 1. 本期已实现收益      | 43,775,426.52  |                           |  |                   |  |                           |  |
| 2. 本期利润         | 112,925,695.29 |                           |  |                   |  |                           |  |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.1575         |                           |  |                   |  |                           |  |
| 4. 期末基金资产净值     | 665,932,549.63 |                           |  |                   |  |                           |  |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.074          |                           |  |                   |  |                           |  |