融通通利系列证券投资基金之融通蓝筹成长证券投资基金

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

§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蓝筹成长证券投资基金(以下简称"本基金")2015年第1季度报告。

基金管理人的董事会及董事保证本报告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。

§2 基金产品概况

基金简称	融通蓝筹成长混合
交易代码	161605
前端交易代码	161605
后端交易代码	161655
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	1,245,143,613.63份
投资目标	组合投资,资本增值,为持有人获取长期稳定的投资收益。
投资策略	在对市场趋势判断的前提下,重视仓位选择和行业配置,同时更重视基本面分析,强调通过基本面分析挖掘个股。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+中信标普全债指数收益率×25%
风险收益特征	力求获得超过市场平均水平的收益,承担相应的风险。
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(2015年1月1日 — 2015年3月31日)
1.本期已实现收益	76,969,464.57
2.本期利润	266,901,467.07
3.加权平均基金份额本期利润	0.1747
4.期末基金资产净值	1,595,687,497.41
5.期末基金份额净值	1.282

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

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	18.81%	1.41%	11.15%	1.39%	7.66%	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

注:本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"国泰君安指数×75%+银行间债券综合指数×25%",2010年1月1日起使用新基准即"沪深300指数收益率×75%+中信标普全债指数收益率×25%"。

§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		
严菲	本基金、融通行业景气混合的基金经理	2007年3月2日	–	11	经济学硕士,具有基金从业资格。曾先后就职于日盛嘉富证券国际上海代表处、红塔证券从事证券研究工作。2006年7月加入融通基金管理有限公司任行业研究员。

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》及其他有关法律法规和《融通通利系列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

2015年一季度,由于1月份监管层对券商"两融"业务的检查,增量资金入市节奏改变,蓝筹股出现一定调整,市场风格再次偏向成长股,之后2-3月份随着央行降息、降准,房地产政策的放松,蓝筹股也有了较好的表现。季度来看,上证指数上涨15.87%,深证成指上涨19.48%,中小板指数上涨46.6%,创业板指数上涨58.67%。板块来看,计算机、传媒、通信、轻工制造、电子、电气设备等行业均大幅上涨。本季度初,受限制"两融"政策的影响,蓝筹成长基金持有的金融股遭受了较大损失,之后本基金开始重点布局智能装备、节能环保、汽车后市场等行业,在季度后半段获得了较好的正收益。

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18.81%,同期业绩比较基准收益率为11.15%。

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	1,198,385,159.00	70.16
	其中:股票	1,198,385,159.00	70.16
2	固定收益投资	330,557,000.00	19.35
	其中:债券	330,557,000.00	19.35
	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	20,367,225.22	1.19
7	其他资产	158,862,768.25	9.30
8	合计	1,708,172,152.47	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	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	724,605,508.52	45.41
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	4,407,000.00	0.28
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	160,841,610.90	10.08
J	金融业	267,989,039.58	16.79
K	房地产业	29,646,000.00	1.86
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	10,896,000.00	0.68
R	文化,体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	1,198,385,159.00	75.10

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	601318	中国平安	1,400,000	109,536,000.00	6.86
2	600577	精达股份	8,800,000	104,192,000.00	6.53
3	600570	恒生电子	679,960	74,034,044.80	4.64
4	000712	锦龙股份	1,850,001	73,223,039.58	4.59
5	300228	富瑞特装	779,979	52,648,582.50	3.30
6	600885	宏发股份	1,679,920	49,104,061.60	3.08
7	002009	天奇股份	1,499,858	43,465,884.84	2.72
8	600006	东风汽车	6,000,919	42,006,433.00	2.63
9	600406	国电南瑞	1,999,930	41,478,548.20	2.60
10	002085	万丰奥威	899,892	38,713,353.84	2.43

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	330,557,000.00	20.72
	其中:政策性金融债	330,557,000.00	20.72
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	330,557,000.00	20.72

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	700,000	70,021,000.00	4.39
2	140218	14国开18	600,000	60,024,000.00	3.76
3	100236	10国开36	500,000	50,180,000.00	3.14
4	120229	12国开29	500,000	49,905,000.00	3.13
5	120215	12国开15	300,000	30,003,000.00	1.88

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本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	1,970,294.52
2	应收证券清算款	145,038,185.85
3	应收股利	–
4	应收利息	9,719,265.00
5	应收申购款	2,135,022.88
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	158,862,768.25

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

本基金本报告期末前十名股票中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	1,199,762,383.52
报告期期间基金总申购份额	1,252,068,841.01
减:报告期期间基金总赎回份额	1,206,687,610.90
报告期期间基金拆分变动份额	–
报告期期末基金份额总额	1,245,143,613.63

§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 影响投资者决策的其他重要信息

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》,经与托管银行、会计师事务所协商一致,自2015年3月27日起本基金对持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值,详见本管理人2015年3月28日公告。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准融通通利系列证券投资基金设立的文件

(二)《融通通利系列证券投资基金基金合同》

(三)《融通通利系列证券投资基金托管协议》

(四)《融通通利系列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

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 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

二〇一五年四月二十二日

融通通利系列证券投资基金之债券投资基金

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

§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")2015年第1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。

§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	235,437,250.62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
下属分级基金的基金简称	融通债券A/B类 / 融通债券C类
下属分级基金的交易代码	161603 / 161693
下属分级基金的前端交易代码	161603 / 161693
下属分级基金的后端交易代码	161653 / –
报告期末下属分级基金的份额总额	139,467,797.69份 / 95,969,452.93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(2015年1月1日 — 2015年3月31日)	
	融通债券A/B类	融通债券C类
1. 本期已实现收益	4,050,844.81	3,290,717.10
2. 本期利润	204,401.94	721,456.20
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0013	0.0050
4. 期末基金资产净值	153,149,838.45	104,790,270.68
5. 期末基金份额净值	1.098	1.092

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	0.00%	0.14%	0.62%	0.10%	−0.62%	0.04%

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	−0.09%	0.14%	0.62%	0.10%	−0.71%	0.04%

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

§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		
王超	本基金、融通四季添利债券(LOF)、融通通源短融债券、融通七天理财债券、融通岁岁添利定期开放债券、融通标普中国可转债指数增强的基金经理	2013-12-27	–	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。
韩海平	本基金、融通通福分级债、融通通瑞债券、融通通泰保本的基金经理	2013-12-19	–	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,具有基金从业资格,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。

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

2015年一季度,经济复苏压力加大,通胀一度下行至1%以内;经济增速明显下行,资金面较为宽松,债券收益率先下后上。1-2月份,工业增加值增速大幅下滑至6.8%,较去年同期下降1.8个百分点;固定资产投资增速为13.9%,较去年同期下降了4个百分点;社会消费品零售总额同比增长10.7%,较去年同期下降了1.1个百分点;生产及需求均极为低迷。

1-2月份受益于宽松的资金面及对货币政策宽松的预期,债券市场收益率大幅下行;随着央行2月份降准降息后,股市在3月份开始大幅上涨,市场风险偏好大幅提升,受打新资金分流及地方债发行放量的影响,债券收益率大幅反弹。

投资方面,本基金在一季度,降低了城投债的仓位,提高了组合的流动性和资质水平。

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0.00%,融通债券C类份额净值增长率为-0.09%,同期业绩比较基准收益率为0.62%。

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	437,369,618.00	93.04
	其中:债券	427,466,618.00	90.94
	资产支持证券	9,903,000.00	2.11
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	15,712,940.78	3.34
7	其他资产	16,980,280.49	3.61
8	合计	470,062,839.27	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	99,138,000.00	38.43
	其中:政策性金融债	99,138,000.00	38.43
4	企业债券	236,027,618.00	91.50
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	92,301,000.00	35.78
7	可转债	–	–
8	其他	–	–
9	合计	427,466,618.00	165.72

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	140216	14国开16	500,000	50,215,000.00	19.47
2	124725	14曲靖投	289,960	31,037,318.40	12.03
3	124782	14潼国投	299,900	30,994,665.00	12.02
4	101456069	14甘公投MTN002	300,000	29,715,000.00	11.52
5	150205	15国开05	300,000	28,917,000.00	11.21

5.4 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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1489149	14通元1B	100,000	9,903,000.00	3.84

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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五名权证投资明细

本基金不进行主动权证投资,本报告期末未持有因投资可分离转债而获配的权证。

5.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.7.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期未投资国债期货。

5.7.2 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。

5.7.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	11,359.96
2	应收证券清算款	1,989,934.39
3	应收股利	–
4	应收利息	12,573,224.57
5	应收申购款	2,405,761.57
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	16,980,280.49

5.8.3 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	融通债券A/B类	融通债券C类
报告期期初基金份额总额	163,264,781.78	144,287,494.29
报告期期间基金总申购份额	175,533,214.86	49,026,795.99
减:报告期期间基金总赎回份额	199,330,198.95	97,344,837.35
报告期期间基金拆分变动份额	–	–
报告期期末基金份额总额	139,467,797.69	95,969,452.93

§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 影响投资者决策的其他重要信息

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》,经与托管银行、会计师事务所协商一致,自2015年3月27日起本基金对持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值,详见本管理人2015年3月28日公告。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准融通通利系列证券投资基金设立的文件

(二)《融通通利系列证券投资基金基金合同》

(三)《融通通利系列证券投资基金托管协议》

(四)《融通通利系列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

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 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

二〇一五年四月二十二日

融通通利系列证券投资基金之融通深证100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

§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深证100指数证券投资基金(以下简称"本基金")2015年第1季度报告。

基金管理人的董事会及董事保证本报告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。

§2 基金产品概况

基金简称	融通深证100指数
交易代码	161604
前端交易代码	161604
后端交易代码	161654
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	8,564,126,690.86份
投资目标	运用指数化投资方式,通过控制股票投资组合与深证100指数的跟踪误差,力求实现对深证100指数的有效跟踪,谋求分享中国经济的持续、稳定增长和中国证券市场的发展,实现基金资产的长期增长,为投资者带来稳定回报。
投资策略	以非债券资产90%以上的资金对深证100指数的成份股进行股票指数化投资,股票指数化投资部分不得低于基金资产的80%。采用复制法跟踪深证100指数,对于因流动性等原因导致无法完全复制深证100指数的情况,将采用剩余组合替换等方法避免跟踪误差扩大。
业绩比较基准	深证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(2015年1月1日 — 2015年3月31日)
1.本期已实现收益	856,290,976.76
2.本期利润	2,391,962,253.49
3.加权平均基金份额本期利润	0.2469
4.期末基金资产净值	12,570,982,787.44
5.期末基金份额净值	1.468

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

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	21.12%	1.60%	22.28%	1.55%	−1.16%	0.05%

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:本基金业绩比较基准项目分段计算,其中:2005年8月21日之前(含此日)采用"深证100指数×75%+银行间债券综合指数×25%",2005年8月22日起使用新基准即"深证100指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%"。

§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、融通巨潮100指数(LOF)、融通创业板指数、融通深证成份指数基金经理	2009年5月15日	2015年1月9日	10	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。
何天翔	本基金的基金经理	2014年10月25日	–	6	硕士,具有基金从业资格。2008年7月至2010年3月在华泰联合证券有限公司工作,任金融工程分析师;2010年3月加入融通基金管理有限公司,历任金融工程研究员、专户投资投资经理。

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,由何天翔先生继续担任本基金的基金经理。具体内容请参阅2015年1月9日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《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

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始终。本基金运用指数化投资策略,通过控制股票投资权重与深证100指数成份股自然权重的偏离,有效控制跟踪误差,为投资者提供投资深100指数的一个有效工具。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2015年第一季度市场整体涨幅较大,宽基指数中沪深300指数上涨14.64%,深证100指数上涨23.52%,中小板指数和创业板指数分别上涨46.6%,58.66%。融通深证100指数基金比较基准在2015年第一季度上涨22.28%,同期融通深证100指数基金净值上涨21.12%。

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	11,849,973,288.62	92.96
	其中:股票	11,849,973,288.62	92.96
2	固定收益投资	500,150,000.00	3.92
	其中:债券	500,150,000.00	3.92
	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	137,589,240.89	1.08
7	其他资产	259,243,079.06	2.03
8	合计	12,746,955,608.57	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	169,616,669.72	1.35
C	制造业	6,513,526,813.49	51.81
D	电力,热力,燃气及水生产和供应业	77,628,262.32	0.62
E	建筑业	149,626,403.92	1.19
F	批发和零售业	312,396,522.92	2.49
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	975,437,865.52	7.76
J	金融业	1,774,955,787.43	14.12
K	房地产业	995,953,287.78	7.92
L	租赁和商务服务业	215,706,657.88	1.72
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利,环境和公共设施管理业	361,271,271.71	2.87
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	202,572,086.93	1.61
S	综合	101,281,659.00	0.81
	合计	11,849,973,288.62	94.26

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前十名股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基