

融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)

2015 第二季度 报告

2015年6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:2015年7月20日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事承诺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7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表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,也不保证基金份额持有人不受损失,基金业绩并不表示对本基金未来表现的预测,投资者有风险,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2015年4月1日起至2015年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称	融通巨潮100(L0F)
场内简称	融通巨潮
交易代码	161602
场内简称缩写	融通巨潮
基金运作方式	上市型开放式(L0F)
基金合同生效日	2005年3月14日
报告期末基金份额总额	1,123,245,011.287
投资策略	本基金为增强型股票基金,在跟踪标的指数(中证100指数)的基础上,力求获得超越标的指数的投资收益,追求长期资本增值。本基金采用“自上而下”的资产配置和组合管理模式,在严格控制风险的前提下,力争实现超越标的指数的投资收益。基金以中证100指数为跟踪标的,在此基础上进行适度的主动投资,力争实现超越标的指数的投资收益。本基金力争将基金的跟踪偏离度控制在年化跟踪误差的0.5%以内。
业绩比较基准	中证100指数收益率*95%+银行同业存款利率*5%
风险等级	本基金的风险等级为股票型证券投资基金中高风险等级
基金管理人	融通基金管理有限公司

§ 3 主要财务指标

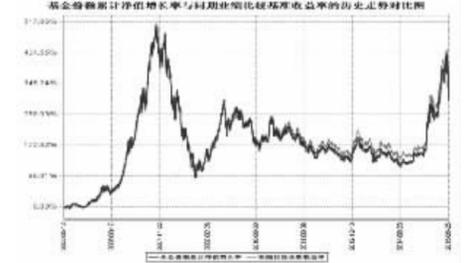
主要财务指标	报告期(2015年4月1日至2015年6月30日)
1.本期基金份额净值	421,043,539.12
2.本期基金份额持有人数量	225,649,087.09
3.加权平均基金份额本期利润	0.1382
4.期末基金份额净值	1,444,458,258.00
5.期末基金份额持有人数量	1,287

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)本报告期末基金份额净值指标不包括持有未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。

§ 3.1 本报告期末基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	6.26%	2.45%	7.03%	2.45%	-0.77%	0.00%

§ 3.2 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对比



§ 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	任本基金基金经理的期限	说明
李勇	本基金基金经理、融通巨潮100(L0F)基金经理、融通巨潮100(L0F)基金经理	2015年1月1日 - -	11
张志刚	本基金基金经理	2015年2月11日 - -	3

注:任职日期指基金经理对外披露的任职日期,基金经理在任职期间内从事证券业务相关的工作时间计算标准。

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》等有关法律法规和基金合同的约定,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,本基金投资运作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
本基金管理人一直秉持公平对待旗下所有投资标的的原则,并制定了相应的制度和流程,在授权、研究、决策、交易和估值等环节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 报告期内本基金投资关联方持仓情况
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中。本基金运用指数化投资策略,通过跟踪标的指数权重与巨潮100指数成份股自然权重的偏差,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。

2015年2季度融通巨潮100指数基金上涨2.86%,同期业绩比较基准上涨0.03%,沪深300上涨10.41%,从各行业业绩的表现来看:轻工(制造)(申万)、国防军工(申万)和交通运输(申万)涨幅分别上涨41.40%、39.66%和3.06%。

4.5 报告期内基金的业绩表现
本报告期末基金份额净值增长率为28.29%,同期业绩比较基准收益率为7.03%。

4.6 报告期内本基金持有重大股权投资资产净值比例情况
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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	1,380,075,175.25	93.87
2	固定收益投资	1,380,075,175.25	93.87
3	货币资金	-	-
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	衍生金融资产	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	42,330,791.31	2.93
9	其他负债	19,538,282.82	1.32
10	合计	1,479,140,802.58	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
A	农林、牧业	-	-
B	采矿业	52,204,097.20	3.52
C	制造业	391,035,315.49	27.07
D	电力、热力、燃气及生产供应业	38,176,341.49	2.64
E	建筑业	79,413,500.88	5.50
F	批发和零售业	5,386,928.78	0.41
G	交通运输、仓储和邮政业	31,335,979.94	2.17
H	信息传输、软件和信息技术业	-	-
I	住宿和餐饮业	38,086,908.91	2.61
J	金融业	664,178,278.19	45.98
K	房地产业	61,646,333.86	4.27
L	租赁和商务服务业	4,099,750.00	0.34
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	国防装备、国防和公共安全	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	其他	12,666,057.60	0.88
T	合计	1,380,075,175.25	95.34

5.4 基金管理人报告

5.5 基金管理人报告

5.6 基金管理人报告

5.7 基金管理人报告

5.8 基金管理人报告

5.9 基金管理人报告

5.10 基金管理人报告

5.11 基金管理人报告

5.12 基金管理人报告

5.13 基金管理人报告

5.14 基金管理人报告

5.15 基金管理人报告

5.16 基金管理人报告

5.17 基金管理人报告

5.18 基金管理人报告

5.19 基金管理人报告

5.20 基金管理人报告

5.21 基金管理人报告

5.22 基金管理人报告

5.23 基金管理人报告

5.24 基金管理人报告

5.25 基金管理人报告

5.26 基金管理人报告

5.27 基金管理人报告

5.28 基金管理人报告

5.29 基金管理人报告

5.30 基金管理人报告

5.31 基金管理人报告

5.32 基金管理人报告

5.33 基金管理人报告

5.34 基金管理人报告

5.35 基金管理人报告

5.36 基金管理人报告

5.37 基金管理人报告

5.38 基金管理人报告

5.39 基金管理人报告

5.40 基金管理人报告

5.41 基金管理人报告

5.42 基金管理人报告

5.43 基金管理人报告

5.44 基金管理人报告

5.45 基金管理人报告

5.46 基金管理人报告

5.47 基金管理人报告

5.48 基金管理人报告

5.49 基金管理人报告

5.50 基金管理人报告

5.51 基金管理人报告

5.52 基金管理人报告

5.53 基金管理人报告

5.54 基金管理人报告

5.55 基金管理人报告

5.56 基金管理人报告

5.57 基金管理人报告

5.58 基金管理人报告

5.59 基金管理人报告

5.60 基金管理人报告

5.61 基金管理人报告

5.62 基金管理人报告

5.63 基金管理人报告

5.64 基金管理人报告

5.65 基金管理人报告

5.66 基金管理人报告

5.67 基金管理人报告

5.68 基金管理人报告

5.69 基金管理人报告

5.70 基金管理人报告

5.71 基金管理人报告

5.72 基金管理人报告

5.73 基金管理人报告

5.74 基金管理人报告

5.75 基金管理人报告

5.76 基金管理人报告

5.77 基金管理人报告

5.78 基金管理人报告

5.79 基金管理人报告

5.80 基金管理人报告

5.81 基金管理人报告

5.82 基金管理人报告

5.83 基金管理人报告

5.84 基金管理人报告

5.85 基金管理人报告

5.86 基金管理人报告

5.87 基金管理人报告

5.88 基金管理人报告

5.89 基金管理人报告

5.90 基金管理人报告

5.91 基金管理人报告

5.92 基金管理人报告

5.93 基金管理人报告

5.94 基金管理人报告

5.95 基金管理人报告

5.96 基金管理人报告

5.97 基金管理人报告

5.98 基金管理人报告

5.99 基金管理人报告

5.100 基金管理人报告

5.101 基金管理人报告

5.102 基金管理人报告

5.103 基金管理人报告

5.104 基金管理人报告

5.105 基金管理人报告

5.106 基金管理人报告

5.107 基金管理人报告

5.108 基金管理人报告

5.109 基金管理人报告

5.110 基金管理人报告

5.111 基金管理人报告

5.112 基金管理人报告

5.113 基金管理人报告

5.114 基金管理人报告

5.115 基金管理人报告

5.116 基金管理人报告

5.117 基金管理人报告

5.118 基金管理人报告

5.119 基金管理人报告

5.120 基金管理人报告

5.121 基金管理人报告

5.122 基金管理人报告

5.123 基金管理人报告

5.124 基金管理人报告

5.125 基金管理人报告

5.126 基金管理人报告

5.127 基金管理人报告

5.128 基金管理人报告

5.129 基金管理人报告

5.130 基金管理人报告

5.131 基金管理人报告

5.132 基金管理人报告

5.133 基金管理人报告

5.134 基金管理人报告

5.135 基金管理人报告

5.136 基金管理人报告

5.137 基金管理人报告

5.138 基金管理人报告

5.139 基金管理人报告

5.140 基金管理人报告

5.141 基金管理人报告

5.142 基金管理人报告

5.143 基金管理人报告

5.144 基金管理人报告

5.145 基金管理人报告

5.146 基金管理人报告

5.147 基金管理人报告

5.148 基金管理人报告

5.149 基金管理人报告

5.150 基金管理人报告

5.151 基金管理人报告

5.152 基金管理人报告

5.153 基金管理人报告

5.154 基金管理人报告

5.155 基金管理人报告

5.156 基金管理人报告

5.157 基金管理人报告

5.158 基金管理人报告

5.159 基金管理人报告

5.160 基金管理人报告

5.161 基金管理人报告

5.162 基金管理人报告

5.163 基金管理人报告

5.164 基金管理人报告

5.165 基金管理人报告

5.166 基金管理人报告

5.167 基金管理人报告