

融通深证成份指数证券投资基金

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

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。

Table with 2 columns: 基金名称, 融通深证成份指数; 交易代码, 161612; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日期, 2009年11月15日; 报告期末基金份额总额, 221,667,920.08份; 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

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2015年4月1日至2015年6月30日); 1.本期已实现收益, 238,987,145.76; 2.本期利润, 88,517,017.73; 3.加权平均基金份额本期利润, 0.2113; 4.期末基金份额净值, 252,669,878.43; 5.期末基金资产净值, 252,669,878.43

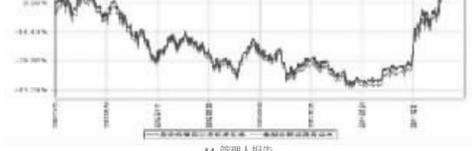
注:①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;
②本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

Table with 6 columns: 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; 最近三个月, 6.19%, 2.66%, 8.60%, 2.86%, -2.41%, 0.08%

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



3.3 基金管理人报告

4.1 基金经理、基金经理小组简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限(任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明; 李勇, 本基金基金经理, 融通深证100指数基金, 融通深证成份指数基金基金经理

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

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
本基金管理人一贯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制度和流程。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发现异常交易行为。

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均跟踪误差小于0.25%,年跟踪误差控制在0.4%的投资目标。

2015年2季度深证成指成份指数基金上涨4.15%,同期业绩比较基准上涨8.6%,沪深300上涨10.41%,从各行业表现来看,除非银行金融、申万下跌外,其他板块普涨,其中轻工、制造、申万、国防军工(申万)领涨。

4.5 报告期内基金的投资组合

4.5.1 本报告期基金份额净值增长率为6.15%,同期业绩比较基准收益率为8.60%。

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 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 组合, 金额(元), 占基金总资产的比例(%) ; 1 权益投资, 238,874,196.34, 94.61; 其中:股票, 238,874,196.34, 94.61

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.4 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.5 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.6 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.7 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.8 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.9 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.10 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.11 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.12 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.13 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.14 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.15 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.16 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.17 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.18 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.19 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.20 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.21 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.22 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.23 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.24 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.25 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.26 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.27 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.28 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.29 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.30 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.31 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.32 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.33 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.34 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.35 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.36 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.37 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.38 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.39 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.40 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.41 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.42 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.43 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.44 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.45 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.46 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.47 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.48 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.49 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.50 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.51 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.52 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.53 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.54 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.55 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.56 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.57 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.58 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.59 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.60 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,581.71, 1.45

5.2.61 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 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, 2,836,133.00, 1.12; B 采矿业, 3,663,5