融通新蓝筹证券投资基金

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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通新蓝筹混合
交易代码	161601
前端交易代码	161601
后端交易代码	161602
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年9月13日
报告期末基金份额总额	3,785,938,203.32份
投资目标	主要投资于处于成长阶段和或熟阶段早期的“新蓝筹”上市公司,通过组合投资,在充分控制风险的前提下实现基金净值的稳定增长,为基金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。在正常市场状况下,股票投资比例浮动范围:30%-75%;债券投资比例浮动范围:20%-55%;权证投资比例浮动范围:0%-3%;现金留存比例浮动范围:不低于5%。
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	在适度风险下追求较高收益
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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4月1日 - 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	3,037,056,730.14
2.本期利润	1,633,843,816.20
3.加权平均基金份额本期利润	0.2866
4.期末基金资产净值	4,995,423,131.36
5.期末基金份额净值	1.3195

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;

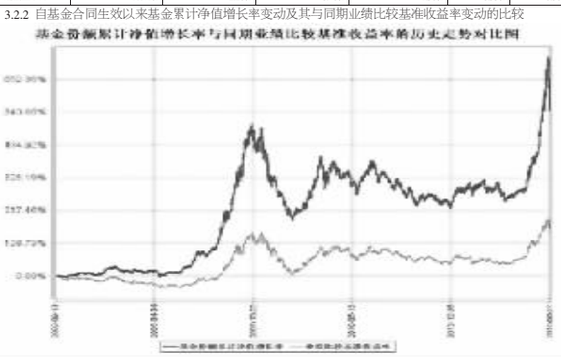
2、表中所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	17.41%	2.26%	8.46%	1.96%	8.95%	0.30%

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:上图中基金业绩比较基准项目分段计算,其中2009年12月31日之前(含此日)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		
姚昆	本基金的基金经理	2012年7月25日	-	10	经济学硕士,具有证券从业资格。硕士毕业后即加入广发证券股份有限公司,任发展研究中心研究员,从事装备制造业上市公司研究工作;2007年加入融通基金管理有限公司,历任研究部行业研究员、行业组长、部门总监助理。

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年二季度,市场经历了罕见的大幅波动。上证指数从3月底的3748点一路上涨到6月中旬的5178点,上涨幅度为38%,创业板二季度最高涨幅为72%。6月份中下旬由于查场外配资以及两融等多因素共振,市场急转直下,随着杠杆资金互相踩踏,市场出现崩塌式下跌。上证指数最低回撤到3847,回撤幅度为26%,而创业板最大回撤幅度为38%。如此大幅的波动是A股历史上所罕见的。

整体而言,本基金自5月底以来,逐步降低了组合的仓位,同时大类资产配置基本稳定,适当提高了金融地产的配置比例,同时适当降低了“互联网+”相关资产的配置比例。在个股上,本基金对中长期看好的一些资产进行了布局,组合持股集中度适当增加,换手率有所提高。在市场回调中,尽管相对较低的仓位和组合中的大盘蓝筹资产起到了一定的组合稳定器的作用,但如此迅速的市场回调和大面积的个股回撤,使得本基金的净值也出现了较大幅度的回撤。

市场在经历了如此剧烈的回调后,杠杆资金的逐步出清和市场信心的恢复都需要一定的时间。随着市场风险偏好的降低,投资人对业绩的增长和估值安全边际的要求会更加苛刻。但是本基金认为泥沙俱下之际正是大浪淘沙的好时机,随着政府稳定市场措施的逐步出台以及上市公司中报业绩的逐步披露,优质公司的投资价值也将逐渐显现出来。本基金将会继续坚持“核心周期龙头+优质成长股”的组合构建思路,在保持组合结构基本稳定的同时精选个股,力争为持有人获取风险调整后的稳定收益。

4.4.2 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17.41%,同期业绩比较基准收益率为8.46%。

4.5 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	3,627,608,834.36	69.58
	其中:股票	3,627,608,834.36	69.58
2	固定收益投资	1,015,947,000.00	19.49
	其中:债券	1,015,947,000.00	19.49
	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	443,981,974.40	8.52
7	其他资产	125,924,527.24	2.42
8	合计	5,213,462,336.00	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	-	-
C	制造业	2,035,950,120.30	40.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	165,600,000.00	3.32
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	425,986,669.50	8.53
J	金融业	409,700,000.00	8.20
K	房地产业	590,372,044.56	11.82
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,627,608,834.36	72.62

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	000024	招商地产	12,000,056	438,122,044.56	8.77
2	601318	中国平安	5,000,000	409,700,000.00	8.20
3	002085	万丰奥威	5,000,021	306,351,286.67	6.13
4	300145	南方泵业	5,500,043	241,726,889.85	4.84
5	002366	丹甫股份	2,500,000	183,450,000.00	3.67
6	600461	洪城水业	8,000,000	165,600,000.00	3.32
7	600037	歌华有线	5,000,053	157,501,669.50	3.15
8	600340	华夏幸福	5,000,000	152,250,000.00	3.05
9	000503	海虹控股	2,800,000	137,200,000.00	2.75
10	600305	恒顺醋业	4,500,011	135,855,332.09	2.72

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	1,015,947,000.00	20.34
	其中:政策性金融债	1,015,947,000.00	20.34
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	1,015,947,000.00	20.34

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	150307	15进出07	2,100,000	211,533,000.00	4.23
2	130238	13国开38	1,400,000	143,458,000.00	2.87
3	120229	12国开29	1,000,000	100,030,000.00	2.00
4	140222	14国开22	700,000	74,480,000.00	1.49
5	130237	13国开37	600,000	61,122,000.00	1.22

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	2,465,839.29
2	应收证券清算款	91,498,119.34
3	应收股利	-
4	应收利息	26,483,104.59
5	应收申购款	5,477,464.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	125,924,527.24

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000024	招商地产	438,122,044.56	8.77	重大事项停牌
2	600461	洪城水业	165,600,000.00	3.32	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	8,418,364,413.30
报告期期间基金总申购份额	160,476,518.62
减:报告期期间基金总赎回份额	4,792,902,728.60
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	3,785,938,203.32

§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新蓝筹证券投资基金设立的文件

(二)《融通新蓝筹证券投资基金基金合同》

(三)《融通新蓝筹证券投资基金托管协议》

(四)《融通新蓝筹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、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
二〇一五年七月二十日

融通医疗保健行业股票型证券投资基金

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

§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7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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通医疗保健股票
交易代码	161616
前端交易代码	161616
后端交易代码	161617
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年7月26日
报告期末基金份额总额	2,016,083,788.93份
投资目标	本基金主要投资于医疗保健行业股票,在合理控制投资风险的基础上,获取基金资产的长期增值,力争实现超越业绩基准的长期收益。
投资策略	本基金主要投资于医疗保健行业股票,立足行业未来发展主要驱动力“变革与创新”,把握医疗政策改革机遇,发掘以药物创新为主的核心竞争力,根据“高增长+核心竞争力”的选股原则精选个股,力争获取超越业绩基准的业绩表现。
业绩比较基准	申万医药生物行业指数收益率×80% + 中信标普全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为主动股票型行业基金,属于预期风险收益水平较高的基金品种,其预期收益和风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
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 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4月1日 - 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	545,819,179.18
2.本期利润	409,289,270.03
3.加权平均基金份额本期利润	0.2221
4.期末基金资产净值	3,646,354,559.60
5.期末基金份额净值	1.809

注:(1)所述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;

(2)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。

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	25.80%	3.20%	19.26%	2.32%	6.54%	0.88%

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		
蒋秀蕾	本基金、融通健康产业灵活配置混合的基金经理	2012-09-06	-	7	药物化学硕士学位,具有基金从业资格。2006年8月起,先后担任朗生医药(纳斯达克)的研究公司产品经理,招商证券研发中心研究员、嘉联融丰投资有限公司投资经理。2009年2月加入融通基金管理有限公司,先后担任研究策划部行业研究员、行业组长。

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年第二季度,市场经历了大幅波动,先是延续一季度的投资风格,以“互联网+”为代表的中小创转型企业继续领涨市场,然而步入6月份后查场外融资等去杠杆事件引发了市场的急剧调整。医药行业走势和创业板走势基本一致,行业本身行业数据(1-5月份统计局公布行业收入利润增长11.5%)继续延续低增长状态,但代表未来发展的行业新方向很多,医疗服务和医药商业两个子行业指数领涨医药指数。第二季度申万医药指数上涨23.6%,跑赢沪深300指数13.2个百分点,整体涨幅居28个申万一级子行业第16位。

医疗保健行业基金在第二季度格遵循基金契约要求,按照资产配置预案要求,坚持“创新+改革”的核心配置思路,积极配置新医药资产,重点布局医药电商、互联网医疗、基因测序细胞治疗等未来空间大的主题性资产,并重点看好医疗器械和医疗服务。对于传统的制药类资产,重点布局中药OTC、中药材和生物制品领域类资产,布局不受药价改革影响的品种并在6月份大盘调整时适当的进行了增持。

展望15年三季度,在去杠杆带来的系统性风险尚未解除时,预计医药行业板块表现很大程度上也将受到大盘影响,重点看好和布局中报业绩稳定或超预期增长的品种,中长期看好代表未来医药发展新方向的资产。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内基金份额净值增长率为25.80%,同期业绩比较基准收益率为19.26%。

4.5 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	3,418,857,991.89	83.94
	其中:股票	3,418,857,991.89	83.94
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	623,552,488.26	15.31
7	其他资产	30,485,639.05	0.75
8	合计	4,072,896,119.20	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	-	-
C	制造业	2,414,072,688.36	66.21
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	615,161,593.81	16.87
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	105,703,000.00	2.90
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	283,920,709.72	7.79
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,418,857,991.89	93.76

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	300015	爱尔眼科	7,500,022	241,950,709.72	6.64
2	600594	益佰制药	3,999,887	232,513,431.31	6.38
3	300109	新开源	2,749,953	195,191,663.94	5.35
4	600682	南京新百	5,000,000	187,650,000.00	5.15
5	600422	昆药集团	3,999,935	147,717,599.55	4.05
6	002462	嘉事堂	2,700,082	143,374,354.20	3.93
7	600055	华润万东	2,700,000	136,215,000.00	3.74
8	600079	人福医药	3,599,969	133,378,851.45	3.66
9	600436	片仔癀	2,000,000	133,340,000.00	3.66
10	002007	华兰生物	3,000,000	132,870,000.00	3.64

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

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	1,292,091.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	109,149.59
5	应收申购款	29,084,397.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,485,639.05

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	1,473,389,858.61
报告期期间基金总申购份额	2,147,471,593.17
减:报告期期间基金总赎回份额	1,604,777,662.85
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	2,016,083,788.93

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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医疗保健行业股票型证券投资基金设立的文件

(二)《融通医疗保健行业股票型证券投资基金基金合同》

(三)《融通医疗保健行业股票型证券投资基金托管协议》

(四)《融通医疗保健行业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开放式基金业务管理规则》

(六)《融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照

(七)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。

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www.rtfund.com查询。

融通基金管理有限公司
二〇一五年七月二十日

融通月月添利定期开放债券型证券投资基金

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:中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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4月1日起至2014年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通月月添利定期开放债券
交易代码	000437
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年8月29日
报告期末基金份额总额	801,039,269.72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	本基金业绩比较基准为一年期银行定期存款税后收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	融通月月添利定期开放债券A	融通月月添利定期开放债券B
下属分级基金的交易代码	000437	000438
报告期末下属分级基金的份额总额	800,809,410.65份	229,859.07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4月1日 - 2015年6月30日)	
	融通月月添利定期开放债券A	融通月月添利定期开放债券B
1.本期已实现收益	15,355,338.89	4,185.56
2.本期利润	27,746,531.72	7,735.15
3.加权平均基金份额本期利润	0.0346	0.0337
4.期末基金资产净值	851,417,899.64	243,668.96
5.期末基金份额净值	1.063	1.060

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、表中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

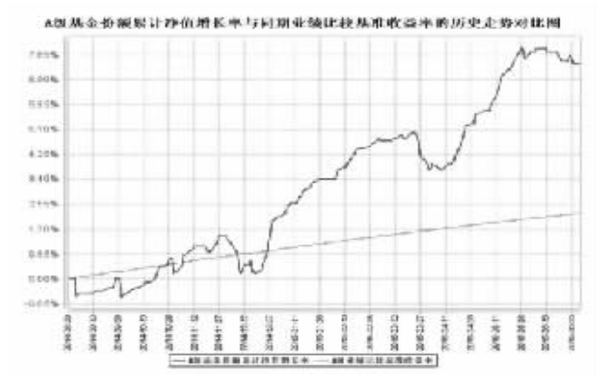
融通月月添利定期开放债券A

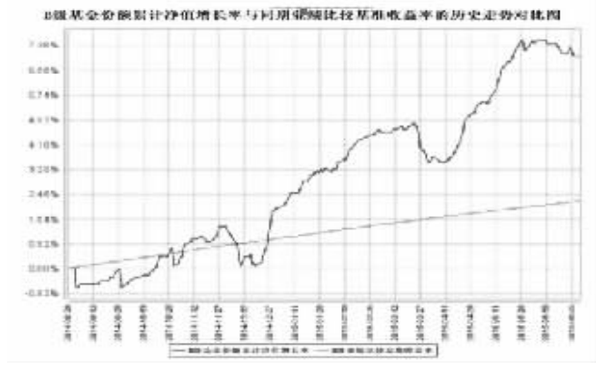
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.30%	0.13%	0.58%	0.01%	2.72%	0.12%

融通月月添利定期开放债券B

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	3.31%	0.12%	0.58%	0.01%	2.73%	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





1、本基金合同生效日为2014年8月29日。

2、本基金的建仓期为自基金合同生效日起6个月,截至报告期末,本基金完成建仓。

§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		
王纯	本基金的基金经理	2014年11月29日	-	8	经济学硕士,具有证券从业资格。2007年9月至2007年12月在中诚信国际工作,任信用分析师;2008年1月至2008年12月在招商证券工作,任债券研究员;2009年1月至2013年10月在中投证券工作,任债券研究员;2013年12月加入融通基金管理有限公司,任债券研究员。

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年上半年经济仍在低位徘徊,虽央行数次降息、降准,并放开二套房购置条件,但仍未有效拉动经济上行。在央行宽松的货币政策影响下,债券市场出现牛陡行情,收益率曲线陡峭化下行趋势明显。1季度在对政策预期落空、地方债供给超预期的背景下,收益率曲线出现了小幅上行;2季度央行宽松意图明确,收益率曲线短端首先出现大幅下行,并带动中长端收益率小幅下行。信用市场虽出现了包括ST湘鄂债、ST中富债等违约事件,但由于此前市场已预期较为充分,收益率未受到明显冲击,信用利差反倒小幅收窄。

融通月月添利基金今年以来积极配置中高等级信用债券和城投债,并适当提高了基金的杠杆水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期A类基金份额净值增长率为3.30%,B类基金份额净值增长率为3.31%,同期业绩比较基准为0.58%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前上半年全面放松的货币政策效果不佳,显示货币政策向实体经济传导的途径不畅通,因此未来经济调控手段或将发生较大变化。政策大概率将由宽货币转向宽信用,财政将全面发力,货币政策将配合财政政策由全面放松向定向放松转变。同于政策传导致实体经济仍需时间,因此三季度经济保持低迷的可能性较大;而四季度的经济状况则需看政策力度。货币政策上,央行有必要继续宽松货币,债券市场利率3季度大概率将继续下行。下一阶段本基金将继续关注信用债的投资机会,择机调整仓位水平。

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