

融通深证成份指数证券投资基金

2013第四季度 报告

2013年12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:2014年1月21日

\$1 重要提示

基金管理人的董事、监事及高级管理人员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的有关规定，于2014年1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2013年10月1日起至2013年12月31日止。

\$2 基金产品概况

基金简称	融通深证成份指数
交易代码	161612
前端交易代码	161612
后端交易代码	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	917,516,775.81份
投资目标	本基金采取完全复制方法进行指数化投资，通过严选的投资纪律和数量化的投资策略，力求实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的跟踪误差在0.35%以内，年化跟踪误差在4%以内，以实现对基金收益的有效跟踪。
业绩比较基准	深证成份指数收益率×95%+银行同期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，属于高风险高收益的基金品种，其收益和风险均高于股票型基金，适合追求较高收益的投资者。
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			
	报告期(2013年10月1日 - 2013年12月31日)			
1.本期已实现收益	-30,460,226.53			
2.本期利润	-36,768,143.87			
3.加权平均基金份额利润	-0.0328			
4.期末基金份额净值	622,289,341.16			
5.期末基金份额净值	0.678			

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,本期利润为期初至本期末实现收益加上本期公允价值变动收益。

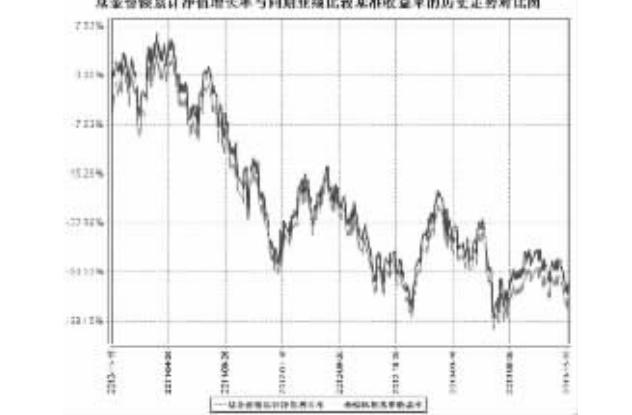
(2)本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	业绩标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.76%	1.11%	-4.30%	1.12%	-0.46%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



§4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介			
姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业年限
王海娟	本基金基金经理,融通深证成份指数基金经理,融通基金管理有限公司基金经理助理,融通基金管理有限公司基金经理助理	2010年11月15日	-
李勇	本基金基金经理,融通深证成份指数基金经理,融通基金管理有限公司基金经理助理,融通基金管理有限公司基金经理助理	2010年11月15日	-
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的工作时间计算为标准。		

4.2 管理人对报告期内基金运作的专项说明

本报告期内,本基金管理人恪守《证券投资基金法》、《融通深证成份指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋取最大利益,无损害基金持有人利益的行为。基金投资操作符合有关法律、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。

4.4 开放式交易的专项说明

本基金报告期未发生异常交易行为。

4.4.1 报告期内本基金投资组合的行业配置情况

本基金为被动指数基金,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构建指数化投资组合,并根据标的指数的权重及其权重的变动进行相应调整,力争实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.5%,月跟踪误差控制在4%的投资源标。

4.4.2 报告期内本基金的买入返售金融资产

4.4.3 报告期内本基金的卖出回购金融资产

4.4.4 报告期内本基金的资产支持证券

4.4.5 报告期内本基金的衍生工具及权证

4.4.6 报告期内本基金的买入返售金融资产

4.4.7 报告期内本基金的卖出回购金融资产

4.4.8 报告期内本基金的其他资产

4.4.9 报告期末本基金的资产支持证券

4.4.10 报告期末本基金的衍生工具及权证

4.4.11 报告期末本基金的买入返售金融资产

4.4.12 报告期末本基金的卖出回购金融资产

4.4.13 报告期末本基金的其他资产

4.4.14 报告期末本基金持有的待摊费用

4.4.15 报告期末本基金持有的待处理财产损益

4.4.16 报告期末本基金持有的其他资产

4.4.17 报告期末本基金持有的其他负债

4.4.18 报告期末本基金持有的其他资产

4.4.19 报告期末本基金持有的其他负债

4.4.20 报告期末本基金持有的其他资产

4.4.21 报告期末本基金持有的其他负债

4.4.22 报告期末本基金持有的其他资产

4.4.23 报告期末本基金持有的其他负债

4.4.24 报告期末本基金持有的其他资产

4.4.25 报告期末本基金持有的其他负债

4.4.26 报告期末本基金持有的其他资产

4.4.27 报告期末本基金持有的其他负债

4.4.28 报告期末本基金持有的其他资产

4.4.29 报告期末本基金持有的其他负债

4.4.30 报告期末本基金持有的其他资产

4.4.31 报告期末本基金持有的其他负债

4.4.32 报告期末本基金持有的其他资产

4.4.33 报告期末本基金持有的其他负债

4.4.34 报告期末本基金持有的其他资产

4.4.35 报告期末本基金持有的其他负债

4.4.36 报告期末本基金持有的其他资产

4.4.37 报告期末本基金持有的其他负债

4.4.38 报告期末本基金持有的其他资产

4.4.39 报告期末本基金持有的其他负债

4.4.40 报告期末本基金持有的其他资产

4.4.41 报告期末本基金持有的其他负债

4.4.42 报告期末本基金持有的其他资产

4.4.43 报告期末本基金持有的其他负债

4.4.44 报告期末本基金持有的其他资产

4.4.45 报告期末本基金持有的其他负债

4.4.46 报告期末本基金持有的其他资产

4.4.47 报告期末本基金持有的其他负债

4.4.48 报告期末本基金持有的其他资产

4.4.49 报告期末本基金持有的其他负债

4.4.50 报告期末本基金持有的其他资产

4.4.51 报告期末本基金持有的其他负债

4.4.52 报告期末本基金持有的其他资产

4.4.53 报告期末本基金持有的其他负债

4.4.54 报告期末本基金持有的其他资产

4.4.55 报告期末本基金持有的其他负债

4.4.56 报告期末本基金持有的其他资产

4.4.57 报告期末本基金持有的其他负债

4.4.58 报告期末本基金持有的其他资产

4.4.59 报告期末本基金持有的其他负债

4.4.60 报告期末本基金持有的其他资产

4.4.61 报告期末本基金持有的其他负债

4.4.62 报告期末本基金持有的其他资产

4.4.63 报告期末本基金持有的其他负债

4.4.64 报告期末本基金持有的其他资产

4.4.65 报告期末本基金持有的其他负债

4.4.66 报告期末本基金持有的其他资产

4.4.67 报告期末本基金持有的其他负债

4.4.68 报告期末本基金持有的其他资产

4.4.69 报告期末本基金持有的其他负债

4.4.70 报告期末本基金持有的其他资产

4.4.71 报告期末本基金持有的其他负债

4.4.72 报告期末本基金持有的其他资产

4.4.73 报告期末本基金持有的其他负债

4.4.74 报告期末本基金持有的其他资产

4.4.75 报告期末本基金持有的其他负债

4.4.76 报告期末本基金持有的其他资产

4.4.77 报告期末本基金持有的其他负债

4.4.78 报告期末本基金持有的其他资产

4.4.79 报告期末本基金持有的其他负债

4.4.80 报告期末本基金持有的其他资产

4.4.81 报告期末