

融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金
2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 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：2016 年 10 月 26 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 2016 年 10 月 21 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 2016 年 7 月 1 日起至 2016 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	融通标普中国可转债指数增强
交易代码	161624
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 3 月 26 日
报告期末基金份额总额	74,364,462.24 份
投资目标	本基金为增强型指数基金，对指数投资部分，采用最优复制法的投资策略，按照成份券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券及其权重的变化进行相应调整。本基金对主动投资部分，采取积极配置策略，利用可转债兼具债券和股票的特性，力争实现在控制基金资产下跌风险和保证投资组合流动性的基础上，为投资者获得超越业绩比较基准的稳健收益。
投资策略	本基金为增强型指数基金，对指数投资部分，采用最优复制法的投资策略，主要以标的指数的成份券及其备选成份券构成为基础，综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合，并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及交易所可转债交易特性等情况，对投资组合进行优化调整，以保证对标的指数的有效跟踪。对主动投资部分，采取积极配置策略，力争在有效跟踪标的指数的基础上，获取超越基准的业绩表现。如果未来可转债市场出现流动性不足、券种数量下降或其它不可预见的异常情况，导致本基金无法有效对指数进行跟

	踪和合理配置,本基金可选择在主动投资部分适当增加对其它金融工具的投资比例,以作为对可转债投资的临时性替代。	
业绩比较基准	标普中国可转债价格指数×95%+银行活期存款利率(税后)×5%	
风险收益特征	本基金是债券型指数基金,长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金,属于较低风险、较低收益的品种。	
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	融通标普中国可转债指数增强 A	融通标普中国可转债指数增强 C
下属分级基金的交易代码	161624	161625
报告期末下属分级基金的份额总额	5,775,620.92 份	68,588,841.32 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 (2016 年 7 月 1 日 — 2016 年 9 月 30 日)	
	融通标普中国可转债指数增强 A	融通标普中国可转债指数增强 C
1. 本期已实现收益	-3,346.11	-83,389.99
2. 本期利润	190,120.82	2,097,912.02
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0316	0.0305
4. 期末基金资产净值	5,137,332.97	60,570,043.74
5. 期末基金份额净值	0.889	0.883

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

融通标普中国可转债指数增强 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	3.61%	0.43%	3.82%	0.42%	-0.21%	0.01%

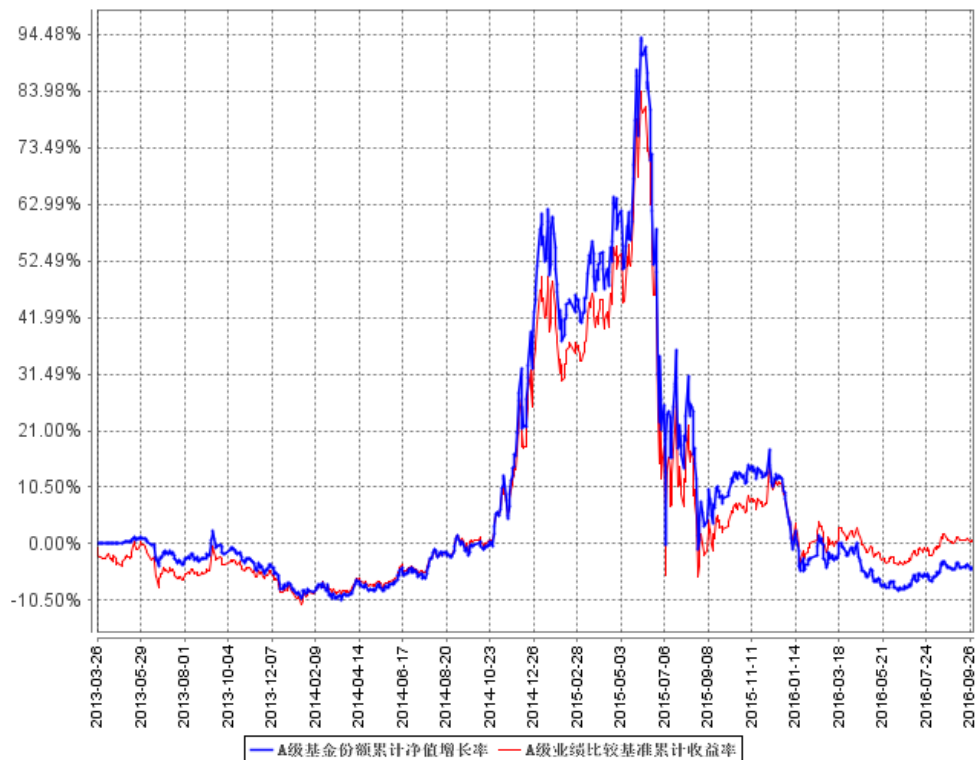
融通标普中国可转债指数增强 C

阶段	净值增长	净值增长率	业绩比较基	业绩比较基准收	①—③	②—④
----	------	-------	-------	---------	-----	-----

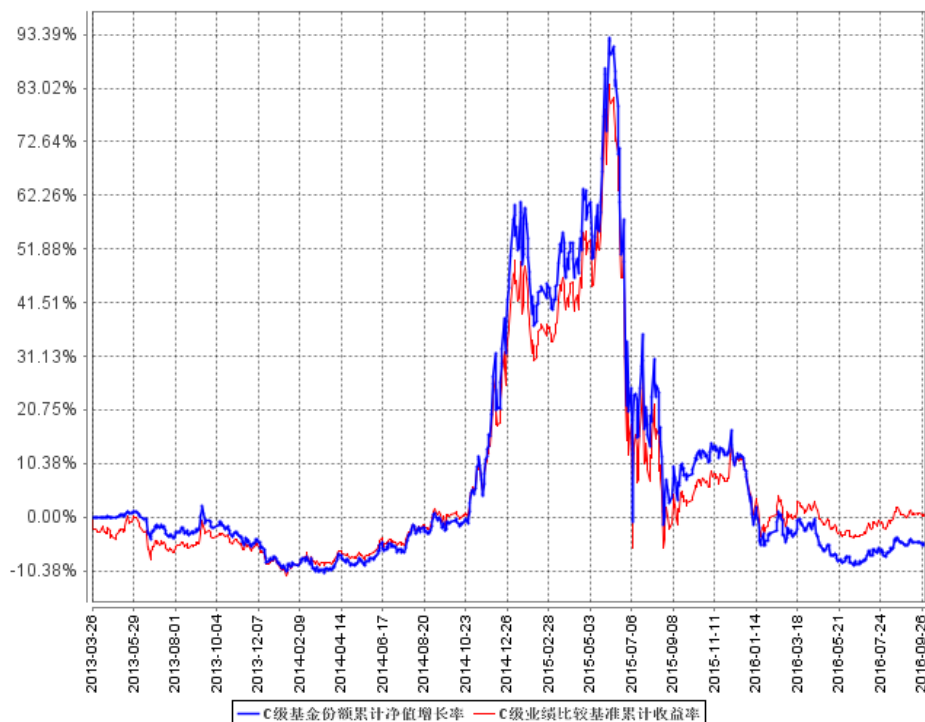
	率①	标准差②	准收益率③	益率标准差④		
过去三个月	3.52%	0.42%	3.82%	0.42%	-0.30%	0.00%

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 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	融通标普中国可转债指数型证券投资基金、融通债券投资基金、融通通源短融债券型证券投资基金、融通四季添利债券证券投资基金(LOF)、融通岁岁添利定期开放债券证券投资基金、融通通瑞债券型证券投资基金、融通增鑫债券型证券投资基金、融通增益债券型证券投资基金、融通增裕债券型证券投资基金、融通通泰保本混合型证券投资基金、融通增丰债券型证券投资基金的基金经理	2013 年 12 月 27 日	-	9	王超先生，金融工程硕士，经济学、数学双学士，9 年证券投资从业经历，具有基金从业资格，现任融通基金管理有限公司固定收益部副总监。历任深圳发展银行（现更名为平安银行）债券自营交易盘投资与理财投资管理经理。2012 年 8 月加入融通基金管理有限公司，2013 年 12 月 27 日起至今任“融通标普中国可转债指数型证券投资基金”、“融通债券投资基金”基金经理，2014 年 11 月 7 日起至今任“融通通源短融债券型证券投资基金”基金经理，2015 年 3 月 14 日起至今任“融通四季添利债券证券投资基金(LOF)”、“融通岁岁添利定期开放债券证券投资基金”基金经理，2015 年 6 月 23 日起至今任“融通通瑞债券型证券投资基金”基金经理，2016 年 5 月 5 日起至今任“融通增鑫债券型证券投资基金”基金经理，2016 年 5 月 11 日起至今任“融通增益债券型证券投资基金”基金经理，2016 年 5 月 13 日起至今任“融通增裕债券型证券投资基金”、“融通通泰保本混合型证券投资基金”基金经理，2016 年 8 月 2 日起至今任“融通增丰债券型证券投资基金”基金经理。

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合规守信情况的说明

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

权益市场在三季度小幅上扬，7、8 月份虽然数据较弱，但流动性充沛，在指数整体稳定的情况下，受无风险利率下行影响，配置偏好开始逐步转向类固收类资产，主营业务稳健，低估值的股票受大家追捧，市场由此展开温和的反弹，至 9 月受美联储加息预期升温及资金面的影响，市场有所调整。

转债市场跟随股市上涨，由于转债估值水平已经相对合理，且转债波动要明显小于正股，因此转债也受益于配置风格的转换，三季度转债指数上涨约 4%。

投资方面，本基金在三季度，保持了组合的稳定。

展望四季度，经济数据有可能出现一个短期的企稳回升。因为去年四季度，地产投资连续出现负增长，受基数效应的影响，地产投资有可能继续回升；此外工业企业利润有所好转，PPI 同比逐步好转，也有可能稳定制造业投资增速。

预计四季度，股市将大概率震荡上扬，下跌空间有限。

4.5 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 3.61%，C 类基金份额净值增长率为 3.52%，同期业绩比较基准为 3.82%。

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	2,875,500.00	4.33
	其中：股票	2,875,500.00	4.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	62,965,721.40	94.84
	其中：债券	62,965,721.40	94.84
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	411,937.04	0.62
8	其他资产	137,820.78	0.21
9	合计	66,390,979.22	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	1,800,700.00	2.74
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	859,200.00	1.31
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	215,600.00	0.33
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	2,875,500.00	4.38

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	600271	航天信息	40,000	882,800.00	1.34
2	600998	九州通	40,000	859,200.00	1.31
3	002241	歌尔股份	20,000	604,600.00	0.92
4	000823	超声电子	20,000	241,600.00	0.37
5	300058	蓝色光标	20,000	215,600.00	0.33
6	002510	天汽模	10,000	71,700.00	0.11

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	3,253,250.00	4.95
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	59,712,471.40	90.88
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	62,965,721.40	95.83

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	113008	电气转债	100,000	11,443,000.00	17.42
2	110032	三一转债	75,000	8,280,000.00	12.60
3	113009	广汽转债	70,000	8,278,200.00	12.60
4	110035	白云转债	56,000	7,089,600.00	10.79
5	110033	国贸转债	45,000	5,675,400.00	8.64

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国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.9.2 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。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	5,616.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	128,413.31
5	应收申购款	3,790.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	137,820.78

5.10.3 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113008	电气转债	11,443,000.00	17.42
2	113009	广汽转债	8,278,200.00	12.60
3	110032	三一转债	8,280,000.00	12.60
4	110035	白云转债	7,089,600.00	10.79
5	110033	国贸转债	5,675,400.00	8.64
6	128009	歌尔转债	3,616,252.00	5.50
7	110031	航信转债	3,361,800.00	5.12
8	123001	蓝标转债	2,709,620.00	4.12
9	110030	格力转债	1,975,520.00	3.01
10	113010	江南转债	1,608,138.00	2.45
11	128010	顺昌转债	1,345,100.00	2.05
12	128011	汽模转债	1,181,670.00	1.80

13	110034	九州转债	1,010,696.70	1.54
----	--------	------	--------------	------

5.10.4 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	002510	天汽模	71,700.00	0.11	重大事项停牌

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通标普中国可转债指数增强 A	融通标普中国可转债 指数增强 C
报告期期初基金份额总额	6,139,499.77	68,819,086.01
报告期期间基金总申购份额	767,028.82	1,078,826.77
减:报告期期间基金总赎回份额	1,130,907.67	1,309,071.46
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	5,775,620.92	68,588,841.32

§ 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标普中国可转债指数增强型证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通标普中国可转债指数增强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
2016 年 10 月 26 日