

融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金 2016 年第  
4 季度报告

2016 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2017 年 1 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 2017 年 1 月 18 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，投资者在做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 10 月 1 日起至 12 月 31 日。

## § 2 基金产品概况

基金简称	融通证券分级		
场内简称	融通证券		
交易代码	161629		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 7 月 17 日		
报告期末基金份额总额	104,826,316.77 份		
投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证全指证券公司指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。		
投资策略	本基金采用完全复制法进行投资，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动对投资组合进行相应调整。		
业绩比较基准	95%×中证全指证券公司价格指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率（税后）。		
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看，融通证券 A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征；融通证券 B 份额具有高预期风险、预期收益相对较高的特征。		
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		
下属分级基金简称	融通证券分级	证券 A 基	证券 B 基
下属分级场内简称	融通证券分级	证券 A 基	证券 B 基
下属分级基金交易代码	161629	150343	150344

下属分级基金报告期末基金份额总额	26,782,800.77 份	39,021,758.00 份	39,021,758.00 份
下属分级基金的风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征。	融通证券 A 份额为稳健收益类份额，具有低预期风险、预期收益相对稳定的风险收益特征	融通证券 B 份额为积极收益类份额，具有高预期风险、预期收益相对较高的风险收益特征。

### § 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 10 月 1 日 — 2016 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	-751,943.64
2. 本期利润	1,499,251.03
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0125
4. 期末基金资产净值	113,981,110.69
5. 期末基金份额净值	1.087

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。

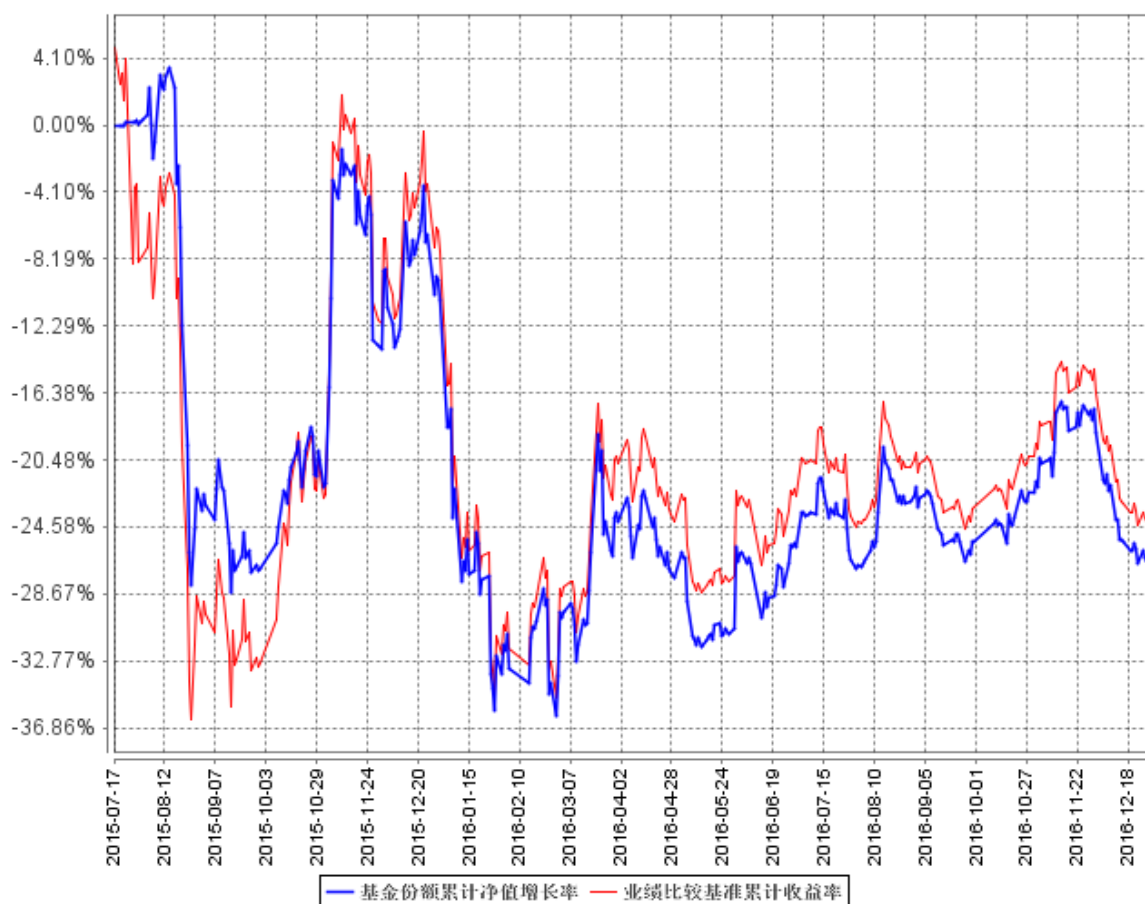
#### 3.2 基金净值表现

##### 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

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	-1.39%	1.14%	-0.88%	1.12%	-0.51%	0.02%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

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		
何天翔	融通深证100指数证券投资基金、融通中证军工指数分级证券投资基金、融通中证全指证券公司指数分级证券投资基	2015年7月17日	-	8	何天翔先生，厦门大学经济学硕士、安徽大学理学学士，8年证券投资从业经历，具有基金从业资格。曾就职于华泰联合证券有限公司任金融工程分析师。2010年3月加入融通基金管理有限公司，历任金融工程研究员、专户投资投资经理，2014年10月25日起至今任“融通深证100指数证券投资基金”基金经理，2015年7月1日起至今任“融通

	金、融通中证大农业指数证券投资基金 (LOF)、融通新趋势灵活配置混合型证券投资基金、融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金的基金经理			中证军工指数分级证券投资基金”基金经理，2015 年 7 月 17 日起至今任“融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金”基金经理，2015 年 8 月 25 日起至今任“融通中证大农业指数证券投资基金 (LOF) (由原融通中证大农业指数分级证券投资基金转型而来)”基金经理，2016 年 8 月 17 日起至今任“融通新趋势灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，2016 年 9 月 23 日起至今任“融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金”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的工作时间为计算标准。

## 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，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

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始终。本基金运用指数化投资策略，通过控制股票投资权重与中证全指证券

公司指数成份股自然权重的偏离，有效控制跟踪误差，为投资者提供投资中证全指证券公司指数的一个有效工具。

本报告期内，本基金日均跟踪偏离为 0.04%，年化跟踪误差为 0.84%，符合基金合同约定。

#### 4.5 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-1.39%，同期业绩比较基准收益率为-0.88%。

#### 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	107,823,759.32	94.29
	其中：股票	107,823,759.32	94.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	6,062,545.67	5.30
8	其他资产	470,780.08	0.41
9	合计	114,357,085.07	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末指数投资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	-	-
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	-	-
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	107,823,759.32	94.60
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	-	-
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	107,823,759.32	94.60

### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末无积极投资部分的股票。

### 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

#### 5.3.1 报告期末指数投资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	600837	海通证券	920,702	14,501,056.50	12.72
2	600030	中信证券	894,728	14,369,331.68	12.61
3	601688	华泰证券	377,111	6,735,202.46	5.91
4	000776	广发证券	341,721	5,761,416.06	5.05
5	600999	招商证券	335,267	5,474,910.11	4.80
6	600958	东方证券	305,165	4,739,212.45	4.16
7	002736	国信证券	284,500	4,423,975.00	3.88
8	000166	申万宏源	696,625	4,353,906.25	3.82
9	601377	兴业证券	540,929	4,138,106.85	3.63
10	601099	太平洋	785,229	4,043,929.35	3.55

#### 5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末无积极投资部分的股票。

### 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 报告期内，基金投资的前十名证券中的发行主体中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、处罚的情况如下：

#### 1、海通证券

2016 年 11 月 28 日，公司收到中国证监会《行政处罚决定书》（[2016]127 号），依据《中华人民共和国证券法》（以下简称《证券法》）的有关规定，证监会对海通证券未按规定审查、了解客户真实身份违法违规行为进行了立案调查、审理，并依法向当事人告知了作出行政处罚的事实、理由、依据及当事人依法享有的权利。当事人海通证券未提出陈述、申辩意见，也未申请听证。本案现已调查、审理终结。根据当事人违法行为的事实、性质、情节和社会危害程度，依据《证



券公司监督管理条例》第八十四条的规定，证监会决定：对海通证券责令改正，给予警告，没收违法所得 28,653,000 元，并处以 85,959,000 元罚款。

## 2、华泰证券

2016 年 11 月 28 日，公司收到中国证监会《行政处罚决定书》（[2016]126 号），依据《中华人民共和国证券法》（以下简称《证券法》）的有关规定，证监会对华泰证券未按规定审查、了解客户真实身份违法违规行为了进行了立案调查、审理，并依法向当事人告知了作出行政处罚的事实、理由、依据及当事人依法享有的权利。当事人华泰证券未提出陈述、申辩意见，也未申请听证。本案现已审理终结。根据当事人违法行为的事实、性质、情节和社会危害程度，依据《证券公司监督管理条例》第八十四条的规定，证监会决定：对华泰证券责令改正，给予警告，没收违法所得 18,235,275.00 元，并处以 54,705,825.00 元罚款。

## 3、广发证券

2016 年 11 月 26 日，公司收到中国证监会《行政处罚决定书》（[2016]128 号），依据《中华人民共和国证券法》（以下简称《证券法》）的有关规定，证监会对广发证券未按规定审查、了解客户真实身份违法违规行为了进行了立案调查、审理，并依法向当事人告知了作出行政处罚的事实、理由、依据及当事人依法享有的权利。当事人广发证券未提出陈述、申辩意见，也未要求听证。本案现已审理终结。根据当事人违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度，依据《证券公司监督管理条例》第八十四条的规定，证监会决定：对广发证券责令改正，给予警告，没收违法所得 6,805,135.75 元，并处以 20,415,407.25 元罚款。

## 4、兴业证券

2016 年 7 月 27 日，兴业证券股份有限公司（以下简称“公司”）及丹东欣泰电气股份有限公司（以下简称“欣泰电气”）IPO 申请文件和公开发行募集文件签字保荐代表人兰翔、伍文祥收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《行政处罚决定书》（〔2016〕91 号）。公司在推荐欣泰电气申请首次公开发行股票并在创业板上市过程中，未遵守业务规则和行业规范，未勤勉尽责地对欣泰电气 IPO 申请文件进行审慎核查，出具的发行保荐书《兴业证券股份有限公司关于丹东欣泰电气股份有限公司之 2012 年度财务报告专项检查自查工作报告》等文件存在虚假记载；在欣泰电气公开发行股票过程中，公司作为主承销商，未审慎核查公开发行募集文件的真实性和准确性，未发现《招股意向书》和《招股说明书》中涉及欣泰电气应收账款、流动资产和经营活动产生的现金流量净额等项目的财务数据存在虚假记载。中国证监会拟决定对公司给予警告，没收保荐业务收入 1,200 万元，并处以 2,400 万元罚款；没收承销股票违法所得 2,078 万元，并处以 60 万元罚款。

本基金依照法律法规及基金合同的约定，采取指数化投资策略，紧密跟踪标的指数。基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。同时，本基金管理人将继续对上述公司进行跟踪研究。

**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	25,403.46
2	应收证券清算款	338,865.15
3	应收股利	-
4	应收利息	1,375.29
5	应收申购款	105,136.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	470,780.08

**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**

**5.11.5.1 报告期末指数投资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	000166	申万宏源	4,353,906.25	3.82	重大事项停牌

**5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末无积极投资部分的股票。

**§ 6 开放式基金份额变动**

单位：份

项目	融通证券分级	证券 A 基	证券 B 基
报告期期初基金份额总额	37,480,761.84	53,338,343.00	53,338,343.00
报告期期间基金总申购份额	23,057,166.68	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	64,430,430.81	-	-
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	30,675,303.06	-14,316,585.00	-14,316,585.00
报告期期末基金份额总额	26,782,800.77	39,021,758.00	39,021,758.00

注：拆分变动份额为本报告期发生的配对转换份额及定期折算份额。

## § 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中证全指证券公司指数分级证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通中证全指证券公司指数分级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  
2017 年 1 月 20 日