

融通中证大农业指数证券投资基金（LOF） 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年1月18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10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	融通中证大农业指数基金（LOF）
场内简称	融通农业
交易代码	161630
基金运作方式	契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2016年7月29日
报告期末基金份额总额	20,533,714.34份
投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证大农业指数。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%×中证大农业指数收益率+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，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
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

§ 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	65,861.56
2. 本期利润	89,462.89
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0038
4. 期末基金资产净值	20,615,149.10
5. 期末基金份额净值	1.004

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。

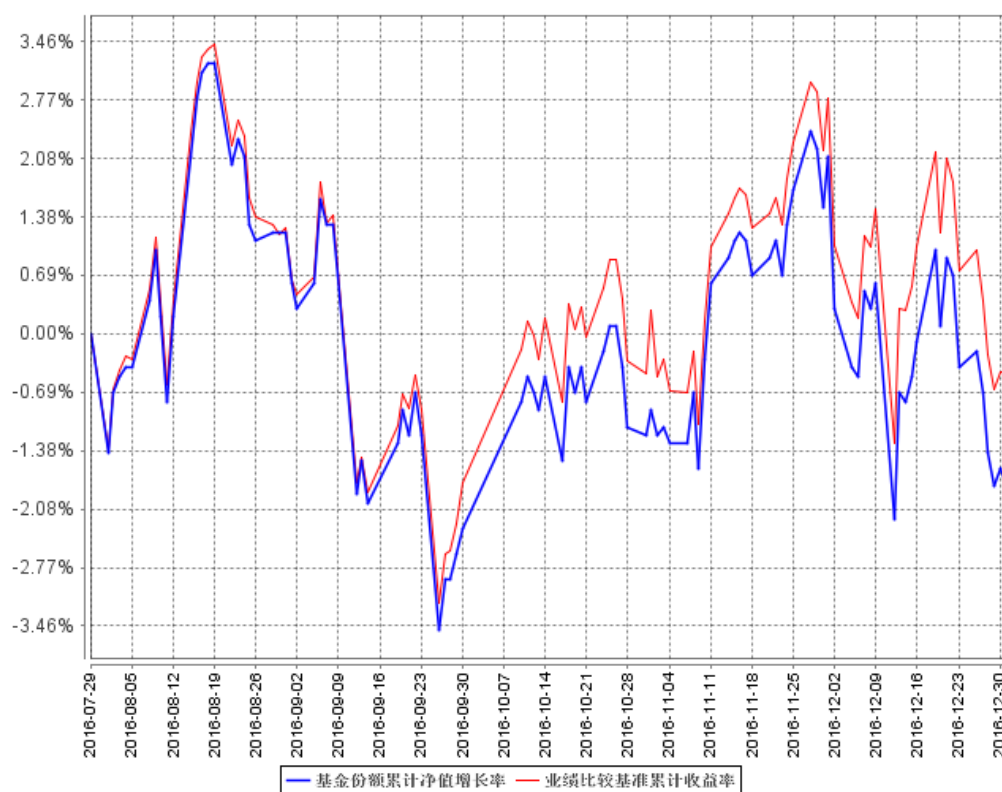
3.2 基金净值表现

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	0.50%	0.72%	1.33%	0.75%	-0.83%	-0.03%

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

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	2016 年 7 月 29 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

	资基金的基金经 理			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：任免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大农业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大农业指数的一个有效工具。

本报告期内，本基金日均跟踪偏离为 0.06%，年化跟踪误差为 1.66%，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收益率为 0.50% ，同期业绩比较基准收益率为 1.33%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

截止本报告期末，本基金存在连续二十个工作日以上基金资产净值低于五千万的情形。

§ 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	19,493,490.80	90.68
	其中：股票	19,493,490.80	90.68
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	1,978,561.37	9.20
8	其他资产	24,211.08	0.11
9	合计	21,496,263.25	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	3,810,228.35	18.48
B	采矿业	-	-
C	制造业	14,358,422.81	69.65
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	566,690.00	2.75
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	403,130.64	1.96
L	租赁和商务服务业	355,019.00	1.72

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	19,493,490.80	94.56

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	000895	双汇发展	42,001	879,080.93	4.26
2	600201	生物股份	25,900	818,181.00	3.97
3	000876	新希望	88,372	711,394.60	3.45
4	002385	大北农	87,098	618,395.80	3.00
5	000792	盐湖股份	31,500	600,705.00	2.91
6	000998	隆平高科	26,695	572,073.85	2.78
7	000930	中粮生化	40,900	549,696.00	2.67
8	002004	华邦健康	60,400	547,828.00	2.66
9	600737	中粮屯河	43,400	540,764.00	2.62
10	002470	金正大	66,600	526,140.00	2.55

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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存在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。

生物股份:2016年12月1日,金宇生物技术股份有限公司(以下简称“公司”)收到中国证券监督管理委员会内蒙古监管局(以下简称“内蒙古证监局”)《关于对金宇生物技术股份有限公司采取责令改正措施的决定》([2016]7号,以下简称“《决定书》”)。针对公司会计估计变更未披露、公司财务报表列报不准确、内幕信息知情人登记执行不到位等问题,根据《上市公司信息披露管理办法》第五十九条及《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》第十五条的规定,我局决定对你公司采取责令改正的行政监管措施。

盐湖股份:中国证券监督管理委员会青海监管局(以下简称“青海证监局”)于2016年10月24日至11月4日对公司募集资金、内部控制、固定资产核算及管理进行了专项现场检查。近日,公司收到了青海证监局《关于对青海盐湖工业股份有限公司采取责令改正措施的决定》(【2016】5号,以下简称“《决定书》”),公司因(1)公司部分募集资金存储不规范;(2)公司非公开发行股票存在未填写内幕信息知情人档案、未制作重大事项进程备忘录情况等行为违反了《上市公司证券发行管理办法》第三十八条第(三)款规定和《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》第十条规定。

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。

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	8,893.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	455.96
5	应收申购款	14,862.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,211.08

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

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	21,834,349.23
报告期期间基金总申购份额	33,644,222.38
减：报告期期间基金总赎回份额	34,944,857.27
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	20,533,714.34

§ 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）《关于以通讯方式召开融通中证大农业指数分级证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》

（二）《融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）基金合同》

（三）融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）托管协议》

（四）《融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）招募说明书》

（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