

融通可转债债券 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

融通可转债债券型证券投资基金是由“融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金”转型而来。2016 年 11 月 11 日至 2016 年 12 月 7 日，“融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金”的管理人融通基金管理有限公司以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议审议并通过了《关于融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金修改基金合同有关事项的议案》，“融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金”基金名称相应变更为“融通可转债债券型证券投资基金”，转型后，基金的投资管理程序、投资策略、投资理念、投资范围等部分基金合同内容发生变化。自 2016 年 12 月 9 日起，《融通可转债债券型证券投资基金基金合同》生效，同日起《融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金基金合同》失效。

详情请参阅 2016 年 12 月 9 日刊登在指定信息披露媒体上的《关于以通讯方式召开融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》。

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。其中：

转型前为 2016 年 10 月 1 日起至 2016 年 12 月 8 日止，

转型后为 2016 年 12 月 9 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

转型后：

基金简称	融通可转债债券
交易代码	161624
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 12 月 9 日
报告期末基金份额总额	74,880,966.04 份

投资目标	在合理控制信用风险、保持适当流动性的基础上，以可转债为主要投资标的，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。	
投资策略	本基金的具体投资策略包括资产配置策略、固定收益类资产投资策略、股票投资策略、权证投资策略以及国债期货投资策略等部分。	
业绩比较基准	中证可转换债券指数收益率*70%+中债综合全价（总值）指数收益率*20%+沪深 300 指数收益率*10%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	融通可转债债券 A	融通可转债债券 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	6, 473, 147. 27 份	68, 407, 818. 77 份

转型前：

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	73, 182, 042. 97 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	4,919,640.25 份	68,262,402.72 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016年12月9日—2016年12月31日）	
	融通可转债债券 A	融通可转债债券 C
1. 本期已实现收益	-49,607.87	-544,532.74
2. 本期利润	-189,002.68	-2,043,052.93
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0296	-0.0299
4. 期末基金资产净值	5,546,459.75	58,137,980.55
5. 期末基金份额净值	0.8568	0.8499

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。

3.1 主要财务指标（转型前）

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8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	-7,320.73	-127,037.17
2. 本期利润	-589.66	-229,301.14
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0001	-0.0033
4. 期末基金资产净值	4,361,656.89	60,049,704.77
5. 期末基金份额净值	0.887	0.880

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（转型后）

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

融通可转债债券 A

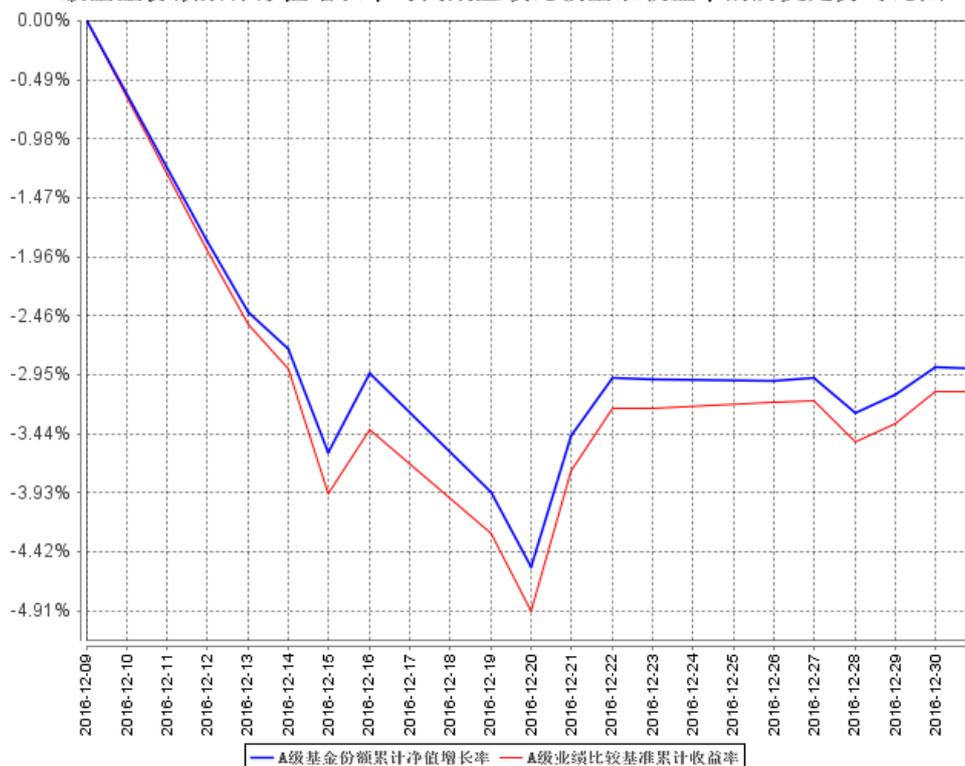
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2016年12月9日-2016年12月31日	-3.26%	0.81%	-3.08%	0.74%	-0.18%	0.07%

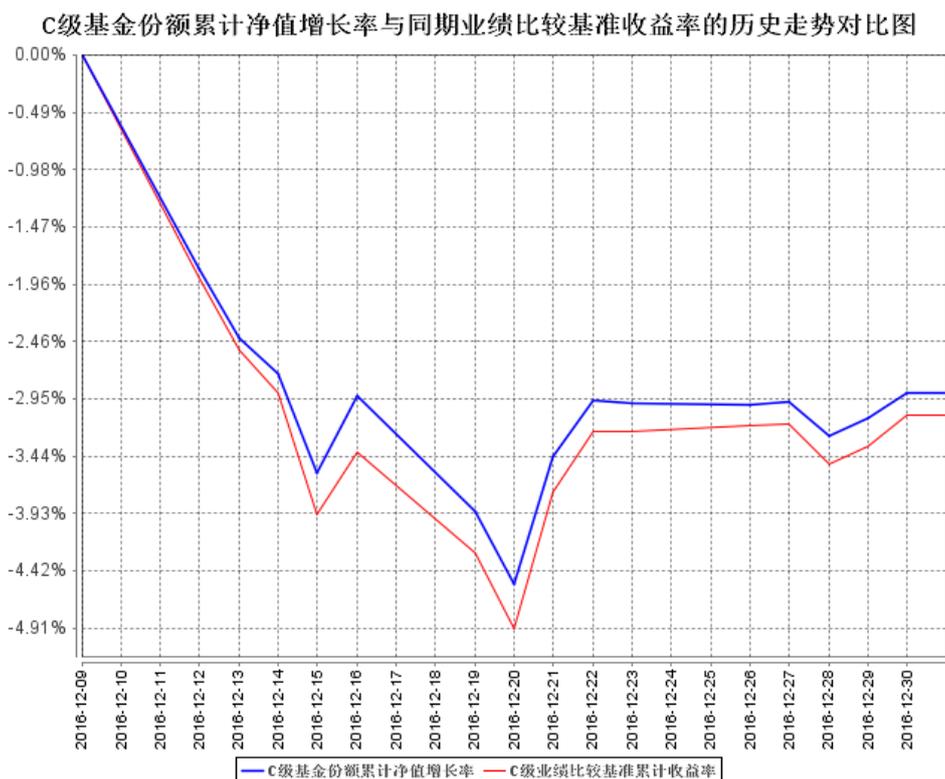
融通可转债债券 C

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
2016年12月9日-2016年12月31日	-3.29%	0.82%	-3.08%	0.74%	-0.21%	0.08%

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





3.2 基金净值表现（转型前）

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

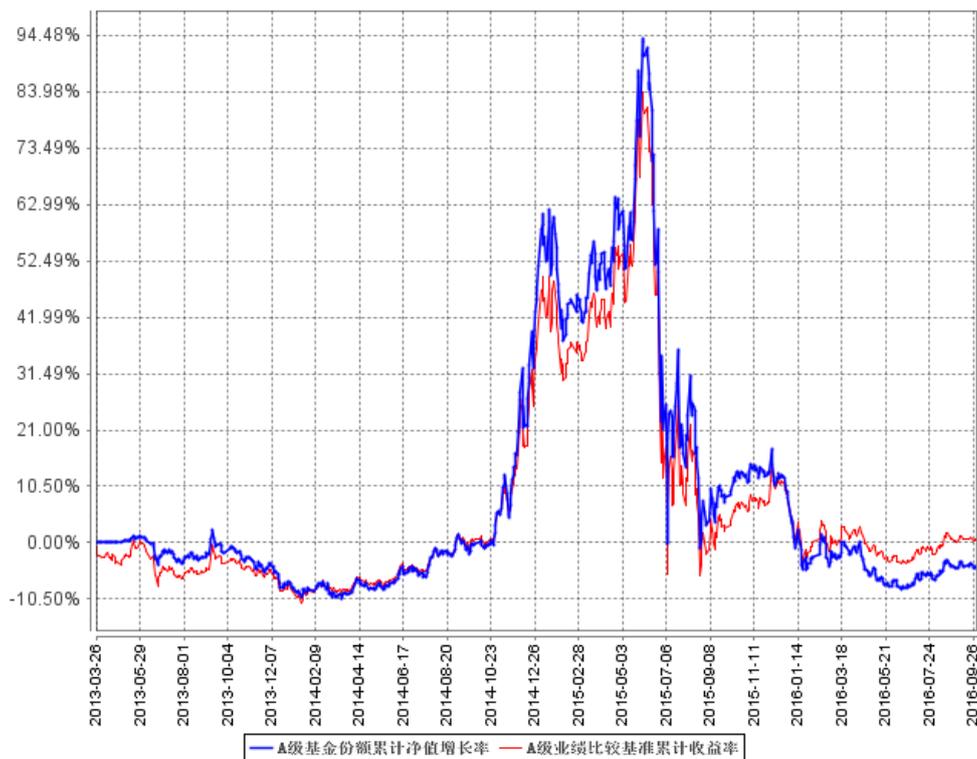
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
2016年10月1日-2016年12月9日	-0.22%	0.34%	-0.19%	0.34%	-0.03%	0.00%

融通标普中国可转债指数增强 C

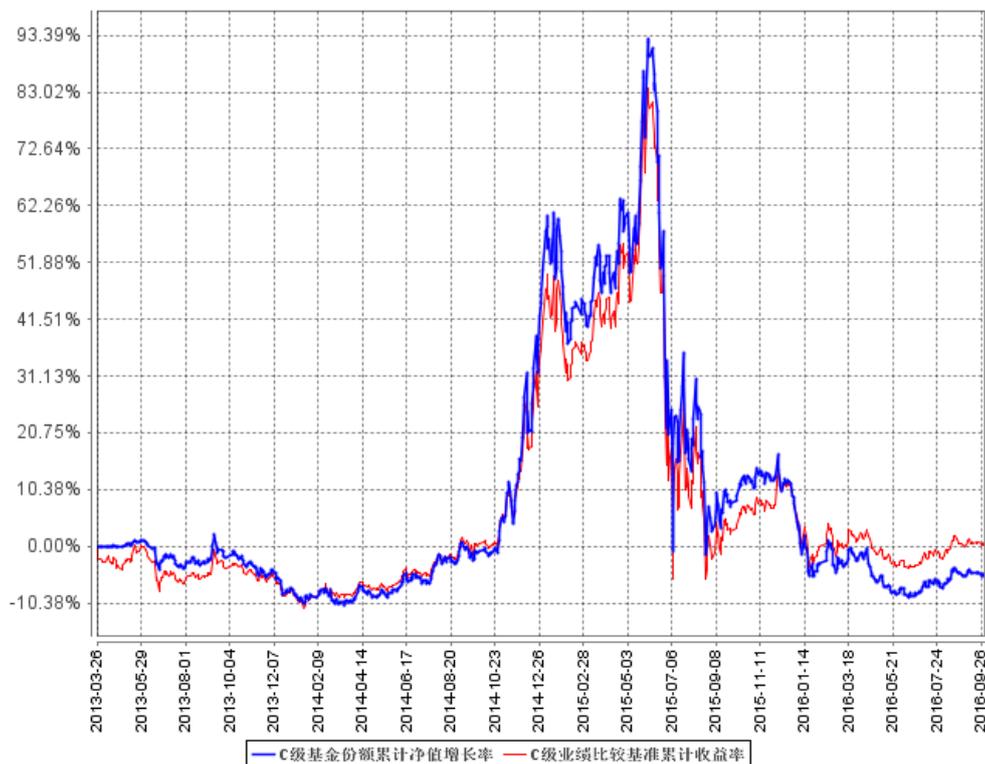
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
2016年10月1日-2016年12月8日	-0.34%	0.32%	-0.19%	0.34%	-0.15%	-0.02%

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（转型前）

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、融通现金宝货币市场基金、融通稳利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，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，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，2016 年 11 月 10 日起至今任“融通现金宝货币市场基金”基金经理，2016 年 11 月 18 日起至今任“融通稳利债券型证券投资基金”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。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

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	融通可转债债券型证券	2016 年 12 月 9 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

	<p>投资基金、融通债券投资基金、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、融通现金宝货币市场基金、融通稳利债券型证券投资基金的基金经理。</p>			<p>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“融通可转债债券型证券投资基金 (由原融通标普中国可转债指数型证券投资基金转型而来)”、“融通债券投资基金”基金经理, 2014 年 11 月 7 日起至 2016 年 11 月 17 日任“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 2016 年 11 月 17 日任“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, 2016 年 11 月 10 日起至今任“融通现金宝货币市场基金”基金经理, 2016 年 11 月 18 日起至今任“融通稳利债券型证券投资基金”基金经理。</p>
--	--	--	--	---

注: 1、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。

2、本基金由“融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金”转型而来, 转型日期为 2016 年 12 月 9 日, 转型前后基金经理均为王超, 其任“融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金”基金经理的任职期间为 2013 年 12 月 27 日起至 2016 年 12 月 8 日止期间。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

权益市场在四季度冲高回落，整体小幅上行。受到不断改善的经济数据影响，指数在 10 月、11 月大幅上行，11 月底开始债市受到流动性冲击出现了快速大幅的下跌，无风险收益率急速攀升，叠加人民币汇率贬值压力骤增，导致市场恐慌情绪蔓延至权益市场，指数从高位开始回落，四季度上证指数上涨 3.3%，振幅近 10%。

转债由于股性与债性均弱，10 月、11 月，转债跟随股市小幅上涨，幅度远不及股市，最高涨幅约 2%，但 12 月受到债市流动性冲击，债券收益率大幅反弹，导致转债一方面遭到投资者抛售应对流动性，一方面需要通过下跌来弥补债性的不足，转债指数在 12 月单月最多下跌了 8%，全季度来看，转债指数下跌了 3.8%。

投资方面，本基金在四季度，保持了组合的稳定。

展望 2017 年 1 季度，经济数据大概率在继续改善，企业利润将继续提升。且 1 季度资金面对宽松，1 季度相对来看可能是全年最佳上涨时机。转债经过 12 月份的大跌后配置价值相对凸显，可能将跟随股市上涨。

4.5 报告期内基金的业绩表现

转型前（2016 年 10 月 1 日 — 2016 年 12 月 8 日）：

本报告期 A 类基金份额净值增长率为-0.22%，C 类基金份额净值增长率为-0.34%，同期业绩比较基准收益率为-0.19%。

转型后（2016 年 12 月 9 日 — 2016 年 12 月 31 日）：

本报告期 A 类基金份额净值增长率为-3.26%，C 类基金份额净值增长率为-3.29%，同期业绩

比较基准收益率为-3.08%。

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

转型后：

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	2,159,700.00	3.38
	其中：股票	2,159,700.00	3.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	58,931,166.90	92.34
	其中：债券	58,931,166.90	92.34
	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	2,567,592.22	4.02
8	其他资产	164,484.20	0.26
9	合计	63,822,943.32	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	730,200.00	1.15
C	制造业	599,900.00	0.94
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	829,600.00	1.30
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	-	-

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	2,159,700.00	3.39

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	600998	九州通	40,000	829,600.00	1.30
2	600547	山东黄金	20,000	730,200.00	1.15
3	002241	歌尔股份	20,000	530,400.00	0.83
4	002510	天汽模	10,000	69,500.00	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	3,245,775.00	5.10
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）	55,685,391.90	87.44
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	58,931,166.90	92.54

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	17.97
2	110032	三一转债	75,000	8,289,000.00	13.02
3	113009	广汽转债	70,000	8,128,400.00	12.76
4	110035	白云转债	51,000	6,352,560.00	9.98
5	110033	国贸转债	45,000	5,157,000.00	8.10

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 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,767.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	148,706.07
5	应收申购款	14,011.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	164,484.20

5.10.4 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	17.97
2	110032	三一转债	8,289,000.00	13.02
3	113009	广汽转债	8,128,400.00	12.76
4	110035	白云转债	6,352,560.00	9.98

5	110033	国贸转债	5,157,000.00	8.10
6	128009	歌尔转债	3,314,304.00	5.20
7	123001	蓝标转债	2,174,200.00	3.41
8	110031	航信转债	2,171,600.00	3.41
9	110034	九州转债	2,157,295.50	3.39
10	113010	江南转债	1,436,400.00	2.26
11	128012	辉丰转债	1,401,920.00	2.20
12	128010	顺昌转债	1,185,300.00	1.86
13	128011	汽模转债	1,092,505.00	1.72
14	110030	格力转债	728,448.00	1.14

转型前:

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	3,132,100.00	4.71
	其中：股票	3,132,100.00	4.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	62,968,619.50	94.71
	其中：债券	62,968,619.50	94.71
	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	137,930.72	0.21
8	其他资产	246,768.00	0.37
9	合计	66,485,418.22	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	1,761,500.00	2.73
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	804,800.00	1.25
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	365,200.00	0.57
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	200,600.00	0.31
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	3,132,100.00	4.86

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	887,600.00	1.38
2	600998	九州通	40,000	804,800.00	1.25
3	002241	歌尔股份	20,000	557,000.00	0.86
4	000776	广发证券	20,000	365,200.00	0.57
5	000823	超声电子	20,000	245,200.00	0.38
6	300058	蓝色光标	20,000	200,600.00	0.31
7	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	3,248,325.00	5.04
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）	59,720,294.50	92.72
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	62,968,619.50	97.76

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	17.77
2	110032	三一转债	75,000	8,552,250.00	13.28
3	113009	广汽转债	70,000	8,467,900.00	13.15
4	110035	白云转债	56,000	7,189,840.00	11.16
5	110033	国贸转债	45,000	5,452,650.00	8.47

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 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,767.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	171,275.67
5	应收申购款	50,725.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	23,000.00
8	其他	-

9	合计	246,768.00
---	----	------------

5.10.4 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	17.77
2	110032	三一转债	8,552,250.00	13.28
3	113009	广汽转债	8,467,900.00	13.15
4	110035	白云转债	7,189,840.00	11.16
5	110033	国贸转债	5,452,650.00	8.47
6	128009	歌尔转债	3,538,436.00	5.49
7	110031	航信转债	3,379,200.00	5.25
8	123001	蓝标转债	2,723,284.00	4.23
9	110030	格力转债	1,884,640.00	2.93
10	113010	江南转债	1,505,700.00	2.34
11	128012	辉丰转债	1,451,450.00	2.25
12	128010	顺昌转债	1,275,500.00	1.98
13	128011	汽模转债	1,181,670.00	1.83
14	110034	九州转债	970,247.30	1.51

5.10.5 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	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（转型后）

单位：份

项目	融通可转债债券 A	融通可转债债券 C
基金合同生效日（2016 年 12 月 9 日） 基金份额总额	4,919,640.25	68,262,402.72
基金合同生效日起至报告期期末基金总 申购份额	1,841,267.46	609,235.25
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	287,760.44	463,819.20
基金合同生效日起至报告期期末基金拆 分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	6,473,147.27	68,407,818.77

§ 7 开放式基金份额变动（转型前）

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
基金合同生效日（2013 年 3 月 26 日） 基金份额总额	-	-
报告期期初基金份额总额	5,775,620.92	68,588,841.32
报告期期初起至 2016 年 12 月 8 日基金 总申购份额	471,681.52	643,357.29
减：报告期期初起至 2016 年 12 月 8 日 基金总赎回份额	1,327,662.19	969,795.89
报告期期初起至 2016 年 12 月 8 日基金 拆分变动份额	-	-
2016 年 12 月 8 日基金份额总额	4,919,640.25	68,262,402.72

§ 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 9 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- （一）《融通基金管理有限公司关于融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》
- （二）中国证监会批准标普中国可转债指数增强型证券投资基金变更注册的批复
- （三）《融通可转债债券型证券投资基金基金合同》
- （四）《融通可转债债券型证券投资基金托管协议》
- （五）《融通可转债债券型证券投资基金招募说明书》
- （六）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
- （七）《融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金基金合同》
- （八）《融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金托管协议》
- （九）《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

(十) 融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照

(十一) 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

10.3 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