

融通深证成份指数证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 2016 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	194,606,497.03 份
投资目标	本基金采取完全复制方法进行指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内，以实现深证成份指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金，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化进行相应调整，力争实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差控制在 0.35% 以内、年化跟踪误差控制在 4% 的投资目标。
业绩比较基准	深证成份指数收益率×95% + 银行活期存款利率×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混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
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

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	-497,576.41
2. 本期利润	-6,049,279.39
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0313
4. 期末基金资产净值	158,707,922.09
5. 期末基金份额净值	0.816

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损益。

（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。

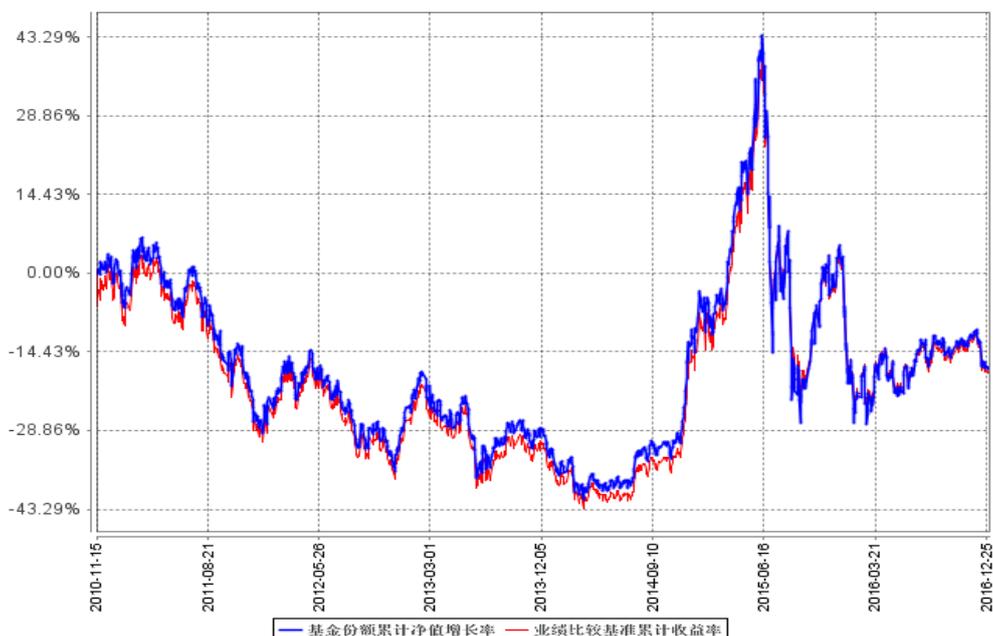
3.2 基金净值表现

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	-3.66%	0.82%	-3.50%	0.81%	-0.16%	0.01%

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		
蔡志伟	融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理, 融通深证成份指数证券投资基金、融通创业板指数增强型证券投资基金的基金经理。	2016 年 11 月 19 日	-	5	蔡志伟先生, 华南师范大学计算机硕士、广州大学计算机学士, 金融风险管理师 (FRM), 5 年证券投资从业经历, 具有基金从业资格。曾就职于汇丰软件开发广东有限公司任高级软件工程师 (SSE)。2011 年 6 月加入融通基金管理有限公司, 历任风险管理专员、金融工程研究员, 2015 年 2 月 11 日起至今任“融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF)”基金经理, 2016 年 11 月 19 日起至今任“融通深证成份指数证券投资基金”、“融通创业板指数增强型证券投资基金”基金经理。
李勇	融通深证成份指数证券投资基金、融通创业板指数增强型证券投资基金、融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理	2010 年 11 月 15 日	-	11	李勇先生, 厦门大学经济学硕士、安徽大学数学学士, 11 年证券投资从业经历, 具有基金从业资格。2005 年 1 月入职融通基金管理有限公司, 历任金融工程研究员、基金经理助理职务。2010 年 11 月 15 日起至今任“融通深证成份指数证券投资基金”基金经理, 2012 年 4 月 6 日起至今任“融通创业板指数增强型证券投资基金”基金经理, 2015 年 1 月 9 日起至今任“融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF)”基金经理。

注: 1、任职日期均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、本基金的基金经理李勇, 于 2017 年 1 月 7 日离任本基金, 具体情况详见 2017 年 1 月 7 日融通深证成份指数证券投资基金基金经理变更公告。

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

本基金为被动式指数基金，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化进行相应调整，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 0.35%、年化跟踪误差控制在 4% 的投资目标。

当前国内经济延续平稳态势，通胀或逐步温和回升，在经济企稳背景下资金将“脱虚向实”，同时监管层加大了去杠杆和严监管的力度，金融市场资金供给将受到挤压。在此背景下，我们看到政策在稳增长和改革转型方面正有序的不断推进，供给侧改革、PPP 项目持续推进；同时，创新仍是拉动经济增长的重要推动力之一，新兴产业仍是未来中国经济的主要发展方向和新的增长点。随着去杠杆和监管趋严，市场资金面和情绪面都将受到抑制，尤其是题材炒作等投机行为将受到严厉监管，投资将更加回归基本面。市场仍将存在结构性行情：随着供给侧改革以及稳增长政策推进，传统周期板块如基建和 PPP 相关等产业将受益；其次，中长期的潜在的通胀风险也将提升传统消费板块和资源品的投资价值；此外，创新和新兴成长的步伐没有停止，随着政策支持、商业模式创新以及业绩推动的进度，新能源、云计算、虚拟现实、人工智能、以及军工电子等都存在阶段性的结构性机会。

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-3.66%，同期业绩比较基准收益率为-3.50%。

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	148,526,535.77	93.44
	其中：股票	148,526,535.77	93.44
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	10,323,801.72	6.49
8	其他资产	100,475.12	0.06
9	合计	158,950,812.61	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	2,123,417.80	1.34
B	采矿业	1,905,220.73	1.20
C	制造业	86,018,116.28	54.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,601,862.50	1.64
E	建筑业	2,844,973.85	1.79
F	批发和零售业	4,089,845.10	2.58
G	交通运输、仓储和邮政业	488,903.51	0.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,294,984.33	10.90
J	金融业	10,471,147.05	6.60
K	房地产业	9,140,095.85	5.76
L	租赁和商务服务业	2,780,312.15	1.75
M	科学研究和技术服务业	313,309.92	0.20
N	水利、环境和公共设施管理业	2,251,592.24	1.42
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	761,926.10	0.48
R	文化、体育和娱乐业	3,595,129.47	2.27
S	综合	664,447.00	0.42
	合计	147,345,283.88	92.84

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

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	100,000.00	0.06
C	制造业	1,074,434.69	0.68
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	6,817.20	0.00
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	1,181,251.89	0.74

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	000002	万科A	159,200	3,271,560.00	2.06
2	000651	格力电器	127,902	3,148,947.24	1.98
3	000333	美的集团	100,097	2,819,732.49	1.78
4	000001	平安银行	224,509	2,043,031.90	1.29
5	000725	京东方A	683,098	1,953,660.28	1.23
6	000858	五粮液	49,705	1,713,828.40	1.08
7	000776	广发证券	81,360	1,371,729.60	0.86
8	002450	康得新	69,357	1,325,412.27	0.84
9	002415	海康威视	53,290	1,268,834.90	0.80
10	002024	苏宁云商	106,105	1,214,902.25	0.77

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

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	000511	*ST 烯碳	33,100	211,178.00	0.13

2	300111	向日葵	29,300	154,411.00	0.10
3	000812	陕西金叶	11,500	143,520.00	0.09
4	000877	天山股份	17,800	125,490.00	0.08
5	000693	ST 华泽	8,000	100,000.00	0.06

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

5.11.1.1 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、处罚的情形。

(1) 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）。违法事实如下：2014 年 9 月 4 日，广发证券对杭州恒生网络技术服务有限责任公司 HOMS 系统（以下简称 HOMS 系统）开放接入，2014 年 12 月 5 日，广发证券上海分公司对该系统开放专线接入，2015 年 5 月 19 日，专线连通。2015 年 3 月 30 日，广发证券上海分公司为上海铭创软件技术有限公司 FPRC 系统（以下简称 FPRC 系统）安装第三个交易网关。对于上述外部接入的第三方交易终端软件，广发证券未进行软件认证许可，未对外部系统接入实施有效管理，对相关客户身份信息情况缺乏了解。广发证券未按照《证券登记结算管理办法》第二十四条，《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条，《中国证监会关于加强证券经纪业务管理的规定》第三条第（四）项，《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户的信息身份进行审查和了解，违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定，构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第（四）项所述的行为，获利 6,805,135.75 元。

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，我会决定：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。

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	2,089.24
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,086.33
5	应收申购款	96,299.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	100,475.12

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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

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	000693	ST 华泽	100,000.00	0.06	重大资产重组停牌

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	194,027,766.69
报告期期间基金总申购份额	6,566,376.20
减：报告期期间基金总赎回份额	5,987,645.86
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	194,606,497.03

§ 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深证成份指数证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通深证成份指数证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通深证成份指数证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通深证成份指数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

www.rtfund.com 查询。

融通基金管理有限公司
2017 年 1 月 20 日