

融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）（原融通中证大农业指  
数分级证券投资基金）2016 年年度报告摘要

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

送出日期：2017 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示

融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）是由“融通中证大农业指数分级证券投资基金”转型而来。2016 年 6 月 9 日至 2016 年 7 月 4 日，“融通中证大农业指数分级证券投资基金”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，会议审议并于 2016 年 7 月 5 日表决通过了《关于融通中证大农业指数分级证券投资基金修改基金合同有关事项的议案》，本次持有人大会决议报中国证监会备案，并自表决通过之日起生效。基金管理人根据基金份额持有人大会的授权，以 2016 年 7 月 28 日为本基金份额转换基准日，2016 年 7 月 29 日正式实施基金转型。“融通中证大农业指数分级证券投资基金”转型为非分级的指数型基金，基金名称相应变更为“融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）”，融通中证大农业指数分级证券投资基金之基础份额、融通农业 A 份额及融通农业 B 份额均转换为融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）份额。转型后，基金的投资管理程序、投资策略、投资理念、投资范围不变。自 2016 年 7 月 29 日起，《融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效，同日起《融通中证大农业指数分级证券投资基金基金合同》失效。

详情请参阅 2016 年 7 月 6 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》。

基金管理人的董事会、董事保证本报告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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据融通中证大农业指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同规定，于 2017 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。其中：

转型前为 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 7 月 28 日止，

转型后为 2016 年 7 月 29 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

转型后

基金简称	融通中证大农业指数基金（LOF）
场内简称	融通农业
基金主代码	161630
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2016 年 7 月 29 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
报告期末基金份额总额	20,533,714.34 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2017 年 2 月 15 日

转型前

基金简称	融通农业分级		
场内简称	融通农业		
基金主代码	161630		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 8 月 25 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		
报告期末基金份额总额	24,843,137.19 份		
基金合同存续期	2015 年 8 月 25 日至 2016 年 7 月 28 日		
下属分级基金的基金简称	融通农业分级	农业 A	农业 B
下属分级基金的场内简称	融通农业	农业 A	农业 B
下属分级基金的交易代码	161630	150349	150350
报告期末下属分级基金份额总额	24,442,972.19 份	200,082.00 份	200,083.00 份

### 2.2 基金产品说明

转型后

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。

转型前

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。从本基金所分离的两类基金份额来看，融通农业 A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征；融通农业 B 份额具有高预期风险、预期收益相对较高的特征。		
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。	融通农业 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特征。	融通农业 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特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		融通基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	涂卫东	林葛
	联系电话	(0755) 26948666	(010)66060069
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-883-8088、(0755) 26948088	95599
传真		(0755) 26935005	(010)68121816

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.rtfund.com">http://www.rtfund.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

转型后

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年 7 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	30,543.75
本期利润	-381,679.63
加权平均基金份额本期利润	-0.0163
本期基金份额净值增长率	-1.76%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年 12 月 31 日
期末可供分配基金份额利润	0.0135
期末基金资产净值	20,615,149.10
期末基金份额净值	1.004

注：（1）所述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；

(2) 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；

(3) 期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

转型前

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016年1月1日至2016年7月28日	2015年8月25日(基金合同生效日)-2015年12月31日
本期已实现收益	-154.66	2,152,109.77
本期利润	-1,651,202.32	4,349,378.00
加权平均基金份额本期利润	-0.0473	0.0441
本期基金份额净值增长率	-2.48%	5.78%
3.1.2 期末数据和指标	2016年7月28日	2015年末
期末可供分配基金份额利润	0.0314	0.0384
期末基金资产净值	25,391,691.03	38,682,622.79
期末基金份额净值	1.022	1.048

注：(1) 所述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；

(2) 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；

(3) 期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

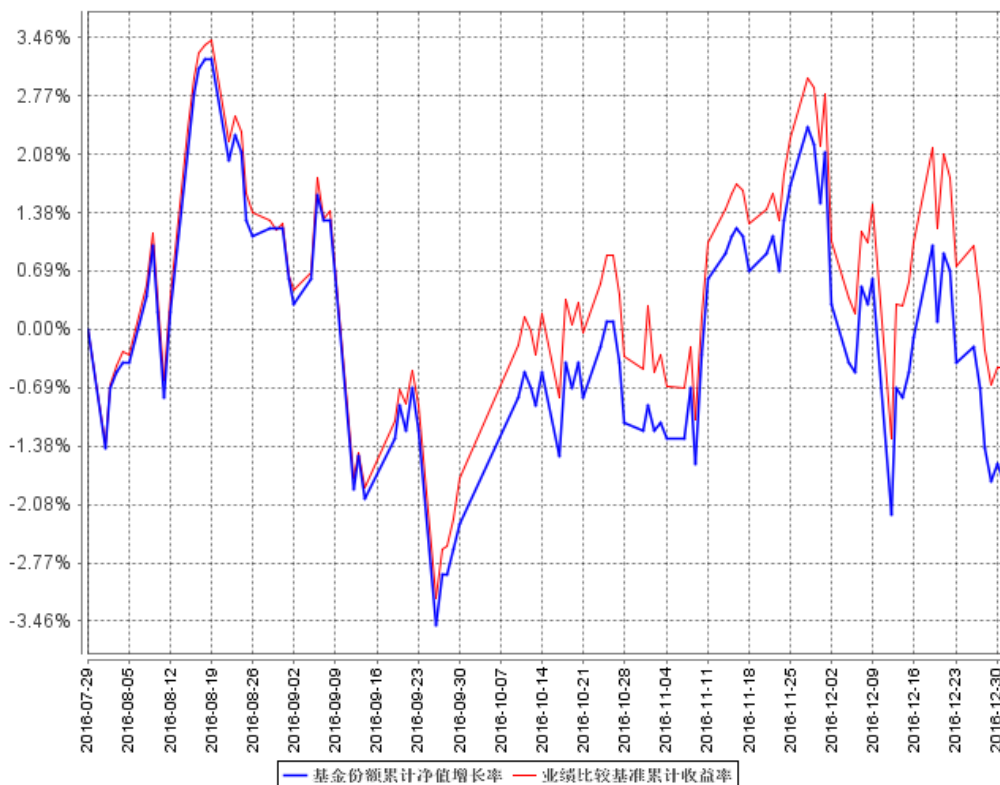
## 3.2 基金净值表现（转型后）

### 3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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%
自基金合同生效起至今	-1.76%	0.75%	-0.45%	0.78%	-1.31%	-0.03%

### 3.2.2 自基金转型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

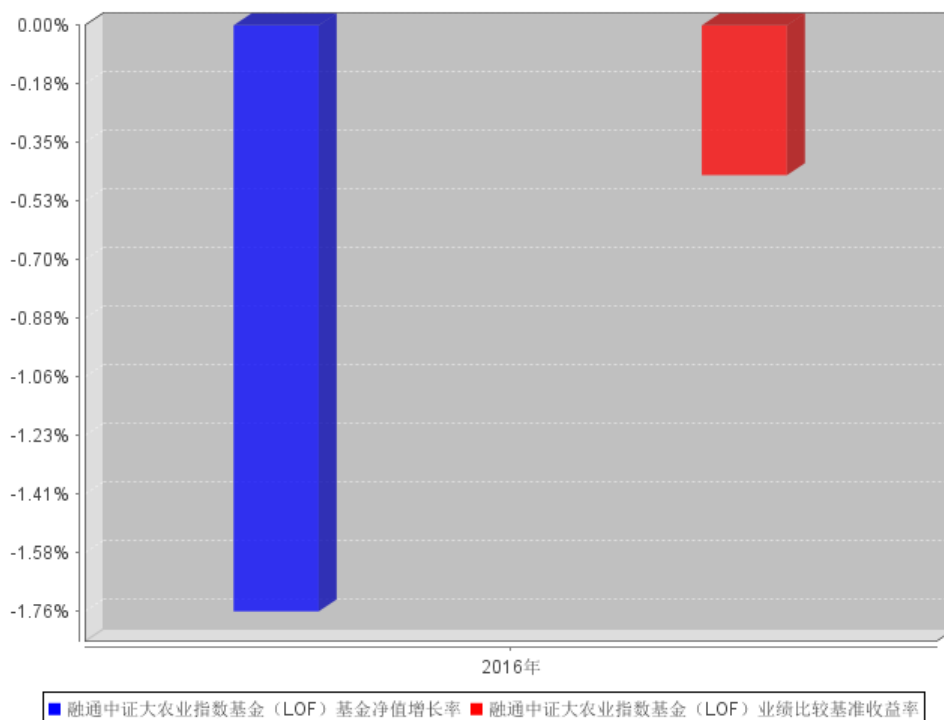
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金由原融通中证大农业指数分级证券投资基金转型而来，转型日期为 2016 年 7 月 29 日。

### 3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

融通中证大农业指数基金（LOF）自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



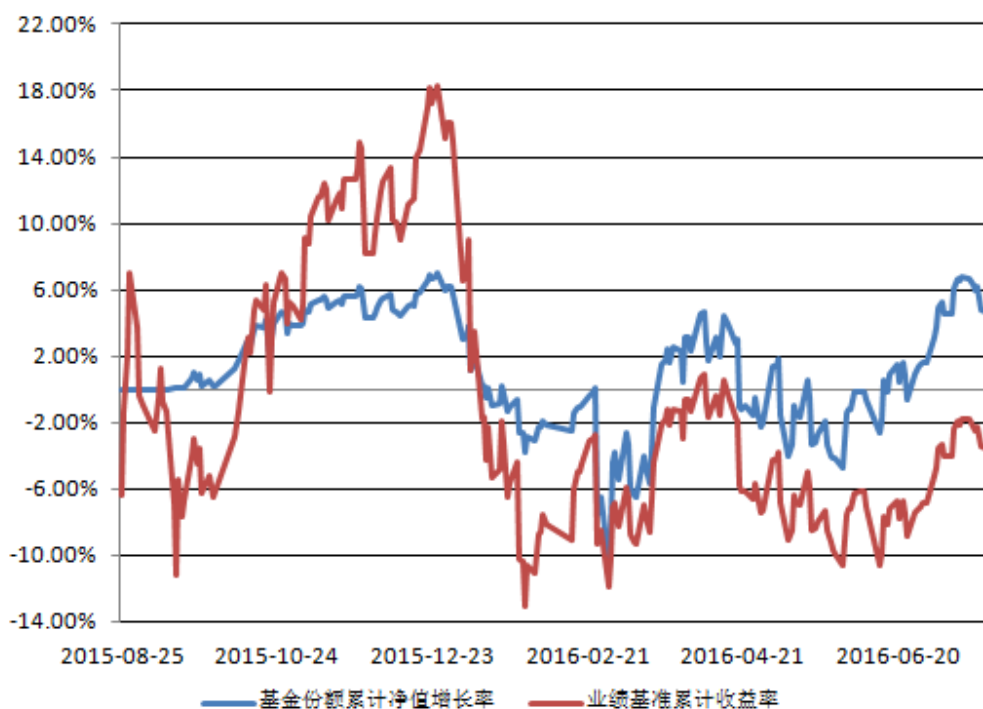
### 3.2 基金净值表现（转型前）

#### 3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2016-7-1 至 2016-7-28	1.39%	1.11%	1.89%	1.12%	-0.50%	-0.01%
2016-1-1 至 2016-7-28	-2.48%	1.57%	-17.36%	1.98%	14.88%	-0.41%
自基金合同生效起至今	3.15%	1.28%	-5.04%	2.06%	8.19%	-0.78%

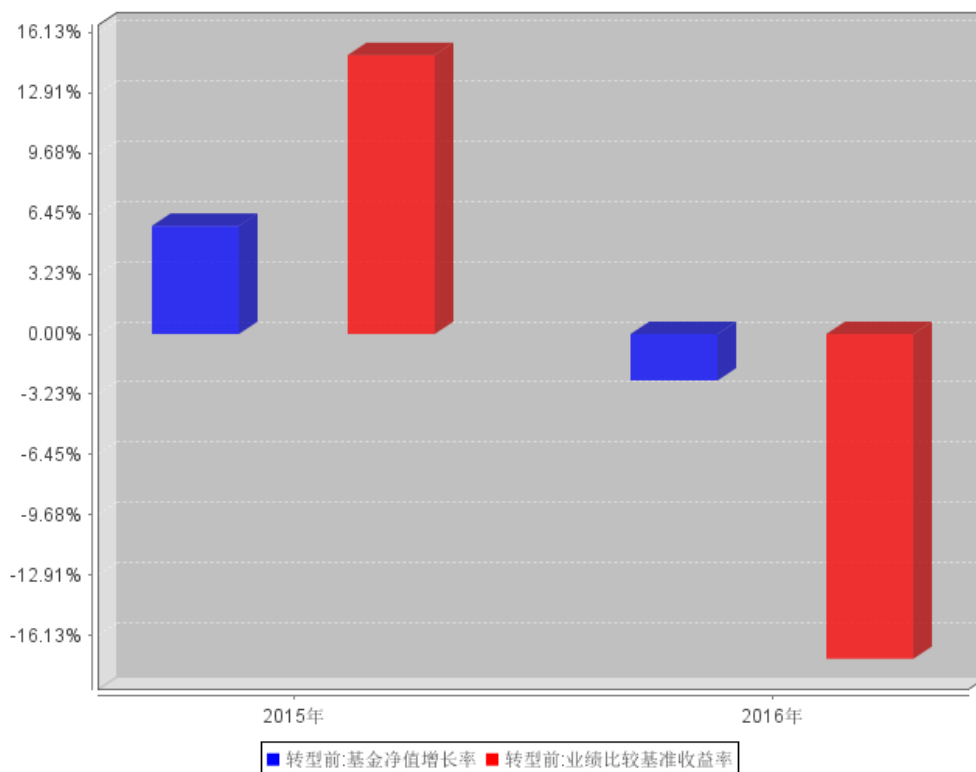
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

#### 转型前

根据本基金基金合同约定，本基金（包括：融通农业份额、农业A份额、农业B份额）不进行收益分配。

#### 转型后

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发放总额	年度利润分配 合计	备注
2016	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

融通基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证监会证监基字[2001]8号文批准，于2001年5月22日成立，公司注册资本12500万元人民币。本公司的股东及其出资比例为：新时代证券股份有限公司60%、日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co., Ltd.）40%。

截至2016年12月31日，公司共管理六十二只开放式基金：即融通新蓝筹混合基金、融通债券基金、融通深证100指数基金、融通蓝筹成长混合基金、融通行业景气混合基金、融通巨潮100指数基金（LOF）、融通易支付货币基金、融通动力先锋股票基金、融通领先成长混合基金（LOF）、融通内需驱动混合基金、融通深证成份指数基金、融通四季添利债券基金、融通创业板指数基金、融通医疗保健混合基金、融通岁岁添利定期开放债券基金、融通丰利四分法（QDII-FOF）基金、融通汇财宝货币市场基金、融通可转债债券基金、融通通泰保本混合基金、融通通泽混合基金、融通通福分级债券基金、融通通源短融债券基金、融通通瑞债券基金、融通月月添利基金、融通健康产业混合基金、融通转型三动力混合基金、融通互联网传媒混合基金、融通新区域新经济混合基金、融通通鑫混合基金、融通新能源混合基金、融通军工分级指数基金、融通证券分级指数基金、融通中证大农业指数基金（LOF）、融通跨界成长混合基金、融通新机遇混合基金、融通成长30混合基金、融通中国风1号混合基金、融通通盈保本混合基金、融通增利债券基金、融通增裕债券基金、融通增鑫债券基金、融通增益债券基金、融通增祥债券基金、融通新消费混合基金、融通增丰债券基金、融通通安债券基金、融通通优债券基金、融通通乾研究精选混合基金、融通新趋势混合基金、融通通景混合基金、融通国企改革新机遇混合基金、融通通尚混合基金、融通新优选混合基金、融通通裕债券基金、融通通和债券基金、融通沪港深智慧生活混合基金、融通现金宝货币市场基金、融通通祺债券基金、融通稳利债券基金、融通通宸债券基金、融通通玺债券基金和融通通穗债券基金。其中，融通债券基金、融通深证100指数基金和融通蓝筹成长混合基金同属融通通利系列证券投资基金。此外，公司还开展了特定客户资产管理业务。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何天翔	本基金的基金经理	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，现任融通深证100指数、融通军工分级、融通证券分级、融通中证大农业指数基金（LOF）（由原融通农业分级转型而来）、融通新趋势灵活配置混合、融通国企改革新机遇灵活配置混合、融通通瑞债券基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写；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“融通中证大农业指数分级证券投资基金”转型而来，转型日期为2016年7月29日，转型前后基金经理均为何天翔，其任“融通中证大农业指数分级证券投资基金”基金经理的任职期间为2015年8月25日（基金合同生效日）起至2016年7月28日止期间。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何天翔	本基金的基金经理	2015年8月25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，现任融通深证100指数、融通军工分级、融通证券分级、融通农业分级、融通新趋势灵活配置混合、融通国企改革新机遇灵活配置混合、融通通瑞债券基金的基金经理。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了保证旗下的不同投资组合得到公平对待，本基金管理人制定了《融通基金管理有限公司公平交易制度》，公平交易制度所规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，并涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

本基金管理人通过建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段来保证公平交易原则的实现。同时，本基金管理人通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

#### 4.3.2 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，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。

本基金管理人对报告期内不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析，各投资组合的同向交易价差均处于合理范围之内。

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。

#### 4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年我国宏观经济整体呈 L 型的新常态运行，经济增速和通胀水平保持在合理健康的发展区间。四季度来看，受益于供给侧改革的坚定推进和实体主动补库周期，PPI 于 12 月快速回升至 +5%，PMI 也连续 3 个月站稳 51 以上，同时 CPI 由低位反弹至 2.1%，同时中微观看，重卡、工程机械等中游行业在补库存周期的带动下，销量同比增速好于预期，上市公司 3 季度的业绩增速也出现持续改善。

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 1.48%，符合基金合同约定。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

转型后（2016 年 7 月 29 日 — 2016 年 12 月 31 日）：

本报告期基金份额净值收益率为-1.76% ，同期业绩比较基准收益率为-0.45%。

转型前（2016 年 1 月 1 日 — 2016 年 7 月 28 日）：

本报告期基金份额净值收益率为-2.48% ，同期业绩比较基准收益率为-17.36%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，一季度由于基建投资需求的加码、供给侧改革的推进，预期 PPI 和 CPI 仍将持续高位，同时 2016 年 12 月的新增信贷高达 1.04 万亿元，超出市场预期，并预计 2017 年 1 月份仍将大量信贷投放，主要由于银行储备项目丰富、制造业信贷需求回暖，叠加按揭贷款的滞后效应，因此预计 17 年一季度各项经济指标将持续企稳。全年来看，严控泡沫的地产投资将会下滑，期待改革的持续推进，带来改革红利和结构改善。

证券市场方面，大盘经过 10 月-11 月两个月的持续反弹后，12 月初至今出现了一定调整，主要压制因素包括债市去杠杆、IPO 资金分流效应、汇率大幅上行压力等。展望一季度，中小创短期可能仍将受压于 IPO 持续和高估值，但部分成长性良好的股票估值已经回到较低位，具备投资价值，而大盘指数由于宏观流动性压力缓解、经济弱复苏预期等，保持相对强势。结构上，注重低估值的优质蓝筹配置，同时关注改革政策相关的主题和真成长个股。

关于大农业行业，在国企改革推进的大背景下，加上 CPI 反弹到 2%以上带来一定的通胀预期，大农业板块具备较好的投资机会，主要机会在于国企改革、土地流转、化肥、通胀收益等板块。本基金为参与大农业行业投资的投资者提供一个指数化的工具。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照《融通基金管理有限公司证券投资基金估值业务原则和程序》进行，公司设立由研究部、风险管理部、登记清算部、固定收益部、国际业务部和监察稽核部共同组成的估值委员会，通过参考行业协会估值意见、参考独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员不包含基金经理。

估值委员会定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经公司总经理办公会议审批后方可实施。基金在采用新投资策略或投资新品种时，应评价现有估值政策和程序的适用性。其中研究部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以

及估值政策和程序进行评价，金融工程小组负责估值方法的研究、价格的计算及复核，登记清算部进行具体的估值核算并计算每日基金净值，每日对基金所投资品种的公开信息、基金会计估值方法的法规等进行搜集并整理汇总，供估值委员会参考，监察稽核部负责基金估值业务的事前、事中及事后的审核工作。基金经理不参与估值决定，参与估值流程各方之间亦不存在任何重大利益冲突，截至报告期末公司未与外部估值定价服务机构签约。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

### **§ 5 托管人报告**

#### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—融通基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### **5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明**

本托管人认为，融通基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### **5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

本托管人认为，融通基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现损害基金持有人利益的行为。

## § 6 审计报告（转型后）

本基金 2016 年年度财务会计报告已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告（普华永道中天审字(2017)第 21208 号），投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 6 审计报告（转型前）

本基金 2016 年年度财务会计报告已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告（普华永道中天审字(2017)第 21220 号），投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表（转型后）

### 7.1 资产负债表（转型后）

会计主体：融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2016 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>	
银行存款	1,968,945.35
结算备付金	9,616.02
存出保证金	8,893.01
交易性金融资产	19,493,490.80
其中：股票投资	19,493,490.80
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	455.96
应收股利	-
应收申购款	14,862.11
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	21,496,263.25
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>

<b>负 债：</b>	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	565,609.13
应付赎回款	197,697.33
应付管理人报酬	13,747.15
应付托管费	3,436.79
应付销售服务费	-
应付交易费用	9,947.01
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	90,676.74
负债合计	881,114.15
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	20,338,927.20
未分配利润	276,221.90
所有者权益合计	20,615,149.10
负债和所有者权益总计	21,496,263.25

注：1、报告截止日 2016 年 12 月 31 日，融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）份额总额 20,533,714.34 份；份额净值为 1.004 元。

2、本基金由融通中证大农业指数分级证券投资基金转型而来，基金转型日为 2016 年 7 月 29 日，2016 年度实际报告期间为 2016 年 7 月 29 日至 2016 年 12 月 31 日。截止报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

## 7.2 利润表

会计主体：融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2016 年 7 月 29 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2016 年 7 月 29 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	-64,266.89
1. 利息收入	11,792.32
其中：存款利息收入	11,792.32
债券利息收入	-
资产支持证券利息收入	-

买入返售金融资产收入	-
其他利息收入	-
2. 投资收益	290,797.13
其中：股票投资收益	246,019.55
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	44,777.58
3. 公允价值变动收益	-412,223.38
4. 汇兑收益	-
5. 其他收入	45,367.04
<b>减：二、费用</b>	<b>317,412.74</b>
1. 管理人报酬	81,060.27
2. 托管费	20,229.27
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	22,875.36
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	193,247.84
<b>三、利润总额</b>	<b>-381,679.63</b>
减：所得税费用	-
<b>四、净利润</b>	<b>-381,679.63</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2016 年 7 月 29 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 7 月 29 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	24,611,773.60	779,917.43	25,391,691.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-381,679.63	-381,679.63
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-4,272,846.40	-122,015.90	-4,394,862.30
其中：1. 基金申购款	33,738,878.45	740,071.25	34,478,949.70
2. 基金赎回款	-38,011,724.85	-862,087.15	-38,873,812.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	20,338,927.20	276,221.90	20,615,149.10



报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>高峰</u>	<u>颜锡廉</u>	<u>刘美丽</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

#### 7.4 报表附注

##### 7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

###### 7.4.1.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

###### 7.4.1.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

###### 7.4.1.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

##### 7.4.2 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
融通基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金代销机构
新时代证券股份有限公司（“新时代证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
日兴资产管理有限公司	基金管理人的股东
深圳市融通资本管理股份有限公司（原深圳市融通资本财富管理有限公司）	基金管理人的子公司
融通国际资产管理有限公司	基金管理人的子公司

##### 7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

###### 7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.3.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 7 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
新时代证券	1,172,947.00	8.53%

###### 7.4.3.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 7 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
-------	--

	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
新时代证券	1,068.94	8.46%	1,068.94	10.75%

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 7.4.3.2 关联方报酬

##### 7.4.3.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年7月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期应支付的管理费	81,060.27
其中：支付销售机构的客户维护费	48,478.37

注：1、支付基金管理人融通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数}。$$

2、客户维护费是基金管理人与基金销售机构约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的费用，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

##### 7.4.3.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年7月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期应支付的托管费	20,229.27

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

##### 7.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.3.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末，基金管理人的主要股东及其控制的机构未持有本基金份额。

#### 7.4.3.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年7月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	1,968,945.35	10,063.38

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金本报告期末未买入管理人、托管人的控股股东在承销期内担任副主承销商或分销商所承销的证券；

2、本基金本报告期末未买入管理人、托管人的主要股东（非控股）在承销期内承销的证券。

#### 7.4.3.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.4 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

##### 7.4.4.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000048	康达尔	2016-12-1	重大事项停牌	37.92	2017-3-1	37.18	11,702	415,611.71	443,739.84	-

注：本基金截至2016年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在债券正回购交易中作为抵押的债券。

## § 7 年度财务报表（转型前）

### 7.1 资产负债表（转型前）

会计主体：融通中证大农业指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 28 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2016 年 7 月 28 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
银行存款	1,432,588.14	26,701,905.13
结算备付金	131,513.74	3,769.16
存出保证金	14,064.28	16,881.10
交易性金融资产	23,937,548.02	12,188,131.50
其中：股票投资	23,937,548.02	12,188,131.50
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	1,640.79	6,187.37
应收股利	-	-
应收申购款	23,702.44	4,360.17
递延所得税资产	-	-
其他资产	32,695.64	-
资产总计	25,573,753.05	38,921,234.43
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016 年 7 月 28 日</b>	<b>本期末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	237.30	-

应付赎回款	64,037.47	60,181.40
应付管理人报酬	21,554.11	35,861.73
应付托管费	4,741.91	7,889.55
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	10,491.72	14,343.44
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	80,999.51	120,335.52
负债合计	182,062.02	238,611.64
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	24,611,773.60	36,574,486.87
未分配利润	779,917.43	2,108,135.92
所有者权益合计	25,391,691.03	38,682,622.79
负债和所有者权益总计	25,573,753.05	38,921,234.43

注：报告截止日 2016 年 7 月 28 日，融通中证大农业指数分级证券投资基金(以下简称“融通中证大农业基金”)之基础份额净值 1.022 元，融通中证大农业基金之 A 份额参考净值 1.034 元，融通中证大农业基金之 B 份额参考净值 1.010 元；基金份额总额 24,843,137.19 份，其中融通中证大农业基金之基础份额 24,442,972.19 份，融通中证大农业基金之 A 份额 200,082.00 份，融通中证大农业基金之 B 份额 200,083.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：融通中证大农业指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 28 日

单位：人民币元

项 目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 28 日	上年度可比期间 2015 年 8 月 25 日(基金合 同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	-1,102,235.93	5,016,483.21
1. 利息收入	42,089.36	255,971.65
其中：存款利息收入	42,089.36	255,971.65
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益	436,956.81	2,219,331.67
其中：股票投资收益	139,892.87	2,219,331.67
基金投资收益	-	-

债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	297,063.94	-
3. 公允价值变动收益	-1,651,047.66	2,197,268.23
4. 汇兑收益	-	-
5. 其他收入	69,765.56	343,911.66
<b>减：二、费用</b>	<b>548,966.39</b>	<b>667,105.21</b>
1. 管理人报酬	200,853.10	357,479.90
2. 托管费	44,187.61	78,645.49
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	106,713.35	47,626.01
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	197,212.33	183,353.81
<b>三、利润总额</b>	<b>-1,651,202.32</b>	<b>4,349,378.00</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润</b>	<b>-1,651,202.32</b>	<b>4,349,378.00</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通中证大农业指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 28 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 28 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	36,574,486.87	2,108,135.92	38,682,622.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,651,202.32	-1,651,202.32
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-11,962,713.27	322,983.83	-11,639,729.44
其中：1. 基金申购款	44,248,862.72	-77,292.66	44,171,570.06
2. 基金赎回款	-56,211,575.99	400,276.49	-55,811,299.50
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	24,611,773.60	779,917.43	25,391,691.03

项目	上年度可比期间		
	2015 年 8 月 25 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	308,362,296.88	-	308,362,296.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,349,378.00	4,349,378.00
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-271,787,810.01	-2,241,242.08	-274,029,052.09
其中：1. 基金申购款	1,050,956.84	47,238.75	1,098,195.59
2. 基金赎回款	-272,838,766.85	-2,288,480.83	-275,127,247.68
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	36,574,486.87	2,108,135.92	38,682,622.79

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____	_____	_____
高峰	颜锡廉	刘美丽
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

#### 7.4.1.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.1.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.1.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.2 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
融通基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金代销机构
新时代证券股份有限公司（“新时代证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
日兴资产管理有限公司	基金管理人的股东

深圳市融通资本管理股份有限公司（原深圳市融通资本财富管理有限公司）	基金管理人的子公司
融通国际资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.3.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年7月28日		上年度可比期间 2015年8月25日(基金合同生效日)至2015年 12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
新时代证券	288,663.00	0.38%	-	-

##### 7.4.3.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年7月28日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
新时代证券	263.04	0.38%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2015年8月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
新时代证券	-	-	-	-

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 7.4.3.2 关联方报酬

##### 7.4.3.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年7月 28日	上年度可比期间 2015年8月25日(基金合同生效日) 至2015年12月31日
当期发生的基金应支付	200,853.10	357,479.90



的管理费		
其中：支付销售机构的客户维护费	100,027.81	122,800.13

注：1、支付基金管理人融通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% / \text{当年天数}。$$

2、客户维护费是基金管理人与基金销售机构约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的费用，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

#### 7.4.3.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 28 日	2015 年 8 月 25 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	44,187.61	78,645.49

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.22% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.22\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.3.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，基金管理人主要股东及其控制的机构均未持有本基金份额。

#### 7.4.3.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 28 日		2015 年 8 月 25 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

中国农业银行	1,432,588.14	41,186.39	26,701,905.13	254,328.02
--------	--------------	-----------	---------------	------------

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金本报告期及上年度可比期间均未买入管理人、托管人的控股股东在承销期内担任副主承销商或分销商所承销的证券；

2、本基金本报告期及上年度可比期间均未买入管理人、托管人的主要股东（非控股）在承销期内承销的证券。

#### 7.4.3.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.4 期末（2016 年 7 月 28 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

##### 7.4.4.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600500	中化国际	2016-7-27	重大事项停牌	10.43	2016-8-29	10.01	41,800	404,830.91	435,974.00	-
002447	壹桥海参	2016-3-9	重大事项停牌	7.16	2016-8-29	7.88	52,400	403,752.28	375,184.00	-

注：本基金截至 2016 年 7 月 28 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

##### 7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在债券正回购交易中作为抵押的债券。

###### 7.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在债券正回购交易中作为抵押的债券。

## § 8 投资组合报告（转型后）

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	其他各项资产	24,211.08	0.11
9	合计	21,496,263.25	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	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

### 8.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

### 8.3.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	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

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人融通基金管理有限公司网站（<http://www.rtfund.com>）的年度报告正文。

## 8.2 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.2.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	000876	新希望	2,131,285.14	10.34
2	000895	双汇发展	1,968,057.40	9.55
3	002385	大北农	1,845,829.75	8.95
4	600201	生物股份	1,620,451.00	7.86
5	300159	新研股份	1,530,384.00	7.42
6	000792	盐湖股份	1,469,822.48	7.13
7	002018	华信国际	1,372,632.00	6.66
8	002004	华邦健康	1,338,615.01	6.49
9	300498	温氏股份	1,302,986.80	6.32
10	600737	中粮屯河	1,227,737.00	5.96
11	000998	隆平高科	1,227,317.57	5.95
12	002470	金正大	1,215,706.00	5.90
13	002714	牧原股份	1,213,484.52	5.89
14	000061	农产品	1,204,976.00	5.85
15	000048	康达尔	1,122,315.00	5.44
16	300146	汤臣倍健	1,027,210.00	4.98
17	002299	圣农发展	1,014,629.90	4.92
18	000979	中弘股份	995,334.00	4.83
19	600500	中化国际	964,728.12	4.68

20	002311	海大集团	963,961.00	4.68
21	600811	东方集团	952,844.00	4.62
22	000902	新洋丰	942,554.11	4.57
23	600873	梅花生物	934,373.00	4.53
24	002250	联化科技	923,835.00	4.48
25	600108	亚盛集团	880,652.00	4.27
26	000592	平潭发展	866,792.00	4.20
27	002568	百润股份	854,940.18	4.15
28	000860	顺鑫农业	795,329.00	3.86
29	600426	华鲁恒升	784,657.00	3.81
30	002477	雏鹰农牧	755,461.00	3.66
31	600872	中炬高新	737,397.24	3.58
32	603288	海天味业	700,104.79	3.40
33	601118	海南橡胶	687,996.00	3.34
34	002481	双塔食品	656,858.00	3.19
35	002588	史丹利	632,732.64	3.07
36	002215	诺普信	624,792.00	3.03
37	000848	承德露露	619,970.27	3.01
38	600298	安琪酵母	604,849.00	2.93
39	600073	上海梅林	567,336.00	2.75
40	000830	鲁西化工	556,055.00	2.70
41	002539	新都化工	546,098.00	2.65
42	000930	中粮生化	531,930.00	2.58
43	002041	登海种业	523,258.17	2.54
44	002157	正邦科技	513,233.00	2.49
45	002505	大康农业	483,324.00	2.34
46	600096	云天化	473,230.00	2.30

注：“买入金额”是指买入股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

### 8.2.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002447	壹桥海参	445,614.00	2.16
2	603288	海天味业	416,097.86	2.02
3	002385	大北农	413,724.76	2.01
4	000895	双汇发展	354,578.00	1.72

5	600438	通威股份	310,324.00	1.51
6	000830	鲁西化工	294,172.00	1.43
7	600965	福成股份	293,260.45	1.42
8	002004	华邦健康	269,313.00	1.31
9	002470	金正大	247,630.00	1.20
10	000792	盐湖股份	240,808.00	1.17
11	000061	农产品	238,077.00	1.15
12	000876	新希望	236,140.00	1.15
13	300159	新研股份	232,273.00	1.13
14	002714	牧原股份	221,267.90	1.07
15	600201	生物股份	218,996.00	1.06
16	603718	海利生物	215,101.41	1.04
17	000998	隆平高科	210,155.12	1.02
18	002299	圣农发展	206,314.17	1.00
19	000979	中弘股份	192,614.00	0.93
20	600298	安琪酵母	186,814.76	0.91

注：“卖出金额”是指卖出股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

### 8.2.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,738,096.92
卖出股票收入（成交）总额	9,015,950.31

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”均按成交单价乘以成交数量填列，相关交易费用不考虑。

### 8.3 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。

### 8.4 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。

### 8.5 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。

### 8.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.7 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。

## 8.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.8.1 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。

### 8.8.2 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。

## 8.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.9.1 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。

### 8.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

截止本报告期末，本基金未投资国债期货。

### 8.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 8.10 投资组合报告附注

### 8.10.1 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。

8.10.2 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。

### 8.10.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
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

### 8.10.4 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。

### 8.12.6 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。

## § 8 投资组合报告（转型前）

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	23,937,548.02	93.60
	其中：股票	23,937,548.02	93.60
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	1,564,101.88	6.12
8	其他资产	72,103.15	0.28
9	合计	25,573,753.05	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元



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	5,449,162.47	21.46
B	采矿业	-	-
C	制造业	16,983,761.84	66.89
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	397,704.00	1.57
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	553,655.71	2.18
L	租赁和商务服务业	553,264.00	2.18
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	23,937,548.02	94.27

## 8.2.2 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股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

### 8.3.1 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000895	双汇发展	53,201	1,282,144.10	5.05
2	002385	大北农	130,900	1,044,582.00	4.11
3	000876	新希望	110,972	935,493.96	3.68
4	000792	盐湖股份	40,300	806,000.00	3.17
5	002470	金正大	90,100	763,147.00	3.01
6	002004	华邦健康	81,800	734,564.00	2.89
7	600201	生物股份	24,800	725,896.00	2.86
8	300159	新研股份	42,782	714,887.22	2.82
9	002299	圣农发展	24,938	713,226.80	2.81

10	300498	温氏股份	17,803	666,722.35	2.63
----	--------	------	--------	------------	------

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人融通基金管理有限公司网站 (<http://www.rtfund.com>) 的年度报告正文。

### 8.3.2 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股票。

## 8.3 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.3.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000876	新希望	2,083,331.14	5.39
2	000895	双汇发展	1,876,595.40	4.85
3	002385	大北农	1,772,970.75	4.58
4	300159	新研股份	1,479,196.00	3.82
5	000792	盐湖股份	1,405,451.48	3.63
6	600201	生物股份	1,372,236.00	3.55
7	002018	华信国际	1,327,787.00	3.43
8	002004	华邦健康	1,276,236.01	3.30
9	300498	温氏股份	1,262,156.80	3.26
10	000061	农产品	1,183,875.00	3.06
11	002714	牧原股份	1,175,295.52	3.04
12	000998	隆平高科	1,162,374.57	3.00
13	002470	金正大	1,151,891.00	2.98
14	000048	康达尔	1,122,315.00	2.90
15	600737	中粮屯河	1,075,712.00	2.78
16	300146	汤臣倍健	988,114.00	2.55
17	002299	圣农发展	973,958.90	2.52
18	000979	中弘股份	946,758.00	2.45
19	002250	联化科技	882,236.00	2.28
20	000902	新洋丰	853,343.11	2.21
21	002568	百润股份	850,901.18	2.20
22	600500	中化国际	832,971.12	2.15
23	000592	平潭发展	829,188.00	2.14
24	002311	海大集团	822,000.00	2.12
25	600811	东方集团	811,756.00	2.10

注：“买入金额”是指买入股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

### 8.3.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000895	双汇发展	1,476,841.31	3.82
2	002385	大北农	1,357,661.02	3.51
3	000876	新希望	1,230,265.00	3.18
4	600201	生物股份	1,082,589.00	2.80
5	000792	盐湖股份	996,388.00	2.58
6	000998	隆平高科	887,313.20	2.29
7	002714	牧原股份	856,750.90	2.21
8	600737	中粮屯河	845,714.00	2.19
9	000061	农产品	775,069.00	2.00
10	300159	新研股份	771,796.45	2.00
11	002004	华邦健康	756,487.00	1.96
12	002299	圣农发展	710,460.88	1.84
13	600500	中化国际	687,221.00	1.78
14	002470	金正大	681,624.00	1.76
15	600811	东方集团	661,141.00	1.71
16	002311	海大集团	656,340.63	1.70
17	000902	新洋丰	630,986.00	1.63
18	300498	温氏股份	627,648.99	1.62
19	002250	联化科技	624,311.00	1.61
20	002018	华信国际	603,376.72	1.56

注：“卖出金额”是指卖出股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

### 8.3.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	44,346,593.09
卖出股票收入（成交）总额	31,086,021.78

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”均按成交单价乘以成交数量填列，相关交易费用不考虑。

## 8.4 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。

## 8.5 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。

**8.6 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。

**8.7 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。

**8.8 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。

**8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****8.9.1 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。

**8.9.2 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。

**8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.10.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末投资国债期货。

**8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

截止本报告期末，本基金未投资国债期货。

**8.10.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**8.11 投资组合报告附注**

8.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内不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。

8.11.2 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。

**8.11.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	14,064.28
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,640.79
5	应收申购款	23,702.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	32,695.64

8	其他	-
9	合计	72,103.15

#### 8.11.4 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。

#### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 8.11.5.2 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股票。

## § 9 基金份额持有人信息（转型后）

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份额 比例
1,081	18,995.11	1.00	0.00%	20,533,713.34	100.00%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	马丹瑾	50,452.00	18.77%
2	杨云帆	50,449.00	18.77%
3	刘京南	50,002.00	18.61%
4	钱金平	35,001.00	13.02%
5	陈奕霖	9,659.00	3.59%
6	高凌	2,897.00	1.08%
7	张成英	1,931.00	0.72%
8	董秋菊	1,931.00	0.72%
9	程大宏	1,931.00	0.72%
10	吕佩仪	1,931.00	0.72%
11	谢军然	1,931.00	0.72%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	4,632.56	0.0226%

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究	0

部门负责人持有本开放式基金	
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 基金份额持有人信息（转型前）

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份 额比例
融通农业分级	958	25,514.58	9,991.99	0.04%	24,432,980.20	99.96%
农业 A	50	4,001.64	1.00	0.00%	200,081.00	100.00%
农业 B	53	3,775.15	0.00	0.00%	200,083.00	100.00%
合计	1,061	23,414.83	9,992.99	0.04%	24,833,144.20	99.96%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

融通农业

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	刘跃刚	182,614.00	65.25%
2	单进	50,448.00	18.03%
3	钱金平	35,000.00	12.51%
4	李斐	10,446.00	3.73%
5	王振国	446.00	0.16%
6	马丹瑾	446.00	0.16%
7	杨云帆	446.00	0.16%
8	郭瑾	2.00	0.00%

农业 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	金海萍	100,012.00	44.43%
2	马丹瑾	25,003.00	11.11%
3	杨云帆	25,002.00	11.11%
4	单进	25,001.00	11.11%
5	刘京南	25,001.00	11.11%
6	王振国	25,001.00	11.11%
7	黄林超	6.00	0.00%
8	杜家玲	4.00	0.00%
9	黄火有	4.00	0.00%
10	夏洪燕	3.00	0.00%
11	刘跃刚	3.00	0.00%

12	丁晓璐	3.00	0.00%
----	-----	------	-------

## 农业 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	金海萍	100,011.00	49.98%
2	马丹瑾	25,003.00	12.50%
3	刘京南	25,001.00	12.50%
4	王振国	25,001.00	12.50%
5	杨云帆	25,001.00	12.50%
6	黄林超	6.00	0.00%
7	刘跃刚	4.00	0.00%
8	夏洪燕	4.00	0.00%
9	杜家玲	4.00	0.00%
10	黄火有	3.00	0.00%

注：持有人为场内持有人，融通农业的场内份额未上市流通。

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	融通农业分级	4,622.77	0.0189%
	农业 A	0.00	0.0000%
	农业 B	0.00	0.0000%
	合计	4,622.77	0.0186%

## 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	融通农业分级	0
	农业 A	0
	农业 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	融通农业分级	0
	农业 A	0
	农业 B	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

基金合同生效日（2016 年 7 月 29 日）基金份额总额	24,843,136.19
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	34,054,068.95
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	38,363,490.80
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	20,533,714.34

注：本基金管理人以 2016 年 7 月 28 日为融通中证大农业指数分级证券投资基金分级份额终止运作转换基准日，对融通农业份额、融通农业 A 份额、融通农业 B 份额进行份额的转换。融通农业 A 份额、融通农业 B 份额转换为融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）的场内份额，融通农业份额的场外、场内份额将分别转换为融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）的场外、场内份额。由于融通农业 A 份额和融通农业 B 份额经份额转换得到的融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）的场内基金份额数将取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金资产，因此，仅持有 1 份融通农业 A 份额、融通农业 B 份额的持有人存在份额被注销的可能性。折算完成后总的基金份额较折算前减少一份。



## § 10 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

项目	融通农业分级	农业 A	农业 B
基金合同生效日（2015 年 8 月 25 日） 基金份额总额	308,362,296.88	-	-
本报告期期初基金份额总额	35,405,744.76	747,112.00	747,113.00
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	44,657,422.16	-	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金 总赎回份额	56,714,254.73	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金 拆分变动份额	1,094,060.00	-547,030.00	-547,030.00
本报告期期末基金份额总额	24,442,972.19	200,082.00	200,083.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

2016 年 7 月 5 日，本基金的基金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，会议审议并于 2016 年 7 月 5 日表决通过了《关于融通中证大农业指数分级证券投资基金修改基金合同有关事项的议案》，本次持有人大会决议报中国证监会备案，并自表决通过之日起生效。基金管理人根据基金份额持有人大会的授权，以 2016 年 7 月 28 日为本基金份额转换基准日，2016 年 7 月 29 日正式实施基金转型。“融通中证大农业指数分级证券投资基金”转型为非分级的指数型基金，基金名称相应变更为“融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）”，融通中证大农业指数分级证券投资基金之基础份额、融通农业 A 份额及融通农业 B 份额均转换为融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）份额。转型后，基金的投资管理程序、投资策略、投资理念、投资范围不变。自 2016 年 7 月 29 日起，《融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效，同日起《融通中证大农业指数分级证券投资基金基金合同》失效。

详情请参阅 2016 年 7 月 6 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》。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 11.2.1 基金管理人的重大变动

2017 年 3 月 4 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第五届董事会第十七次临时会议审议并通过，同意孟朝霞女士辞去公司总经理职务，并决定由公司董事长高峰先生代为履行公司总经理职务。

#### 11.2.2 基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内无诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期末未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。本年度应支付的审计费为人民币 40,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情形。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东兴证券	1	401,490.31	2.92%	365.87	2.89%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	2,341,116.08	17.02%	2,133.50	16.88%	-
申万宏源	1	4,593,685.67	33.40%	4,186.23	33.12%	-
新时代证券	1	1,172,947.00	8.53%	1,068.94	8.46%	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	5,244,808.17	38.13%	4,884.77	38.65%	-

注：1、本基金选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的标准包括以下六个方面：

- （1）资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- （2）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- （3）经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；
- （4）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- （5）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- （6）研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

2、选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的程序包括以下四个步骤：

- (1) 券商服务评价；
- (2) 拟定租用对象。由研究部根据以上评价结果拟定备选的券商；
- (3) 上报批准。研究部将拟定租用对象上报分管副总经理批准；
- (4) 签约。在获得批准后，按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

3、交易单元变更情况

本报告期内交易单元无变更。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东兴证券	1	16,978,053.57	22.51%	15,472.29	22.44%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	11,041,498.16	14.64%	10,061.85	14.60%	-
申万宏源	1	37,480,178.67	49.69%	34,155.95	49.55%	-
新时代证券	1	288,663.00	0.38%	263.04	0.38%	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	9,644,221.47	12.79%	8,981.71	13.03%	-

注：1、本基金选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的标准包括以下六个方面：

- (1) 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的  
需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询  
服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据  
基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

2、选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的程序包括以下四个步  
骤：

- (1) 券商服务评价；
- (2) 拟定租用对象。由研究部根据以上评价结果拟定备选的券商；
- (3) 上报批准。研究部将拟定租用对象上报分管副总经理批准；
- (4) 签约。在获得批准后，按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

### 3、交易单元变更情况

本报告期内交易单元无变更。

## 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	成交金额	占当期权证成 交总额的比例
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

融通基金管理有限公司

二〇一七年三月三十日