

融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金

[2015] 第二季度报告

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:2015年7月20日

基金管理人的董事局及董事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的完整性、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的约定，于2015年7月17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。

本报告期自2015年4月1日起至2015年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称:融通标普中国可转债指数增强型

交易代码:161624

基金运作方式:契约型开放式

基金合同的生效日:2013年3月12日

报告期末基金份额总额:11,493,259.91份

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:2015年7月20日

§ 1 重要提示

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值披露说明
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 2,435,940.00 13.87

其中:股票 2,435,940.00 13.87

2 固定收益投资 13,087,290.32 74.52

其中:债券 13,087,290.32 74.52

3 货币市场工具 - -

4 金融衍生品投资 - -

5 其他资产 - -

其中,买断式回购的买入返售金融资产 - -

6 银行存款和结算备付金合计 1,727,100.49 9.83

7 其他资产 311,797.27 1.78

8 合计 17,562,128.08 100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 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 矿业 - 0.47

C 制造业 1,658,840.00 11.13

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 397,600.00 2.67

K 动力燃料业 354,750.00 2.38

L 代理业 - -

M 科学研究、技术服务业 - -

N 地利、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 - -

9 合计 2,435,940.00 16.34

5.3 报告期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 002241 歌尔声学 39,000 1,400,100.00 9.39

2 600016 民生银行 40,000 397,600.00 2.67

3 000185 格力电器 11,000 354,750.00 2.38

4 600739 上海电气 17,000 253,800.00 1.70

5 600379 金诚信 1,000 24,750.00 0.17

6 002770 科陆电子 500 4,930.00 0.03

5.4 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的债券投资组合

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 806,720.00 5.41

2 央行票据 - -

3 金融债券 - -

4 政策性金融债券 - -

5 企业债 - -

6 中期票据 - -

7 可转债 12,280,070.32 82.38

8 其他 - -

9 合计 13,087,290.32 87.79

5.5 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

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 电气风电 34,000 6,155,360.00 41.29

2 113502 添利债券 28,000 3,904,200.00 26.19

3 113007 吉祥债 8,000 991,200.00 6.65

4 019569 15国债(9) 8,000 806,720.00 5.41

5 128099 歌尔股份 3,994 634,167.32 4.25

5.6 报告期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

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 电气风电 34,000 6,155,360.00 41.29

2 113502 添利债券 28,000 3,904,200.00 26.19

3 113007 吉祥债 8,000 991,200.00 6.65

4 019569 15国债(9) 8,000 806,720.00 5.41

5 128099 歌尔股份 3,994 634,167.32 4.25

5.7 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 金 39,000 1.34

2 银 3,000 0.11

3 铂 1,000 0.04

4 钯 1,000 0.04

5 其他 - -

6 合计 43,000 1.59

5.8 报告期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

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 113008 电气风电 34,000 6,155,360.00 41.29

2 113502 添利债券 28,000 3,904,200.00 26.19

3 113007 吉祥债 8,000 991,200.00 6.65

4 019569 15国债(9) 8,000 806,720.00 5.41

5 128099 歌尔股份 3,994 634,167.32 4.25

5.9 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 金 39,000 1.34

2 银 3,000 0.11

3 铂 1,000 0.04

4 钯 1,000 0.04

5 其他 - -

6 合计 43,000 1.59

5.10 报告期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

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 113008 电气风电 34,000 6,155,360.00 41.29

2 113502 添利债券 28,000 3,904,200.00 26.19

3 113007 吉祥债 8,000 991,200.00 6.65

4 019569 15国债(9) 8,000 806,720.00 5.41

5 128099 歌尔股份 3,994 634,167.32 4.25

5.11 报告期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

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 113008 电气风电 34,000 6,155,360.00 41.29

2 113502 添利债券 28,000 3,904,200.00 26.19

3 113007 吉祥债 8,000 991,200.00 6.65

4 019569 15国债(9) 8,000 806,720.00 5.41

5 128099 歌尔股份 3,994 634,167.32 4.25

5.12 报告期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

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 113008 电气风电 34,000 6,155,360.00 41.29

2 113502 添利债券 28,000 3,904,200.00 26.19

3 113007 吉祥债 8,000 991,200.00 6.65

4 019569 15国债(9) 8,000 806,720.00 5.41

5 128099 歌尔股份 3,994 634,167.32 4.25

5.13 报告期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

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 113008 电气风电 34,000 6,155,360.00 41.29

2 113502 添利债券 28,000 3,904,200.00 26.19

3 113007 吉祥债 8,000 99