

融通中证大农业指数证券投资基金(LOF)

[2016]第四季度报告

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: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。

基金托管人承诺以诚实信用、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。

报告书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)
交易代码	160630
基金运作方式	契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2016年7月20日
报告期末基金份额总额	20,533,714.34份
投资目标	本基金通过投资于大农业行业股票,紧密跟踪中证大农业指数。在正常市场情况下,力争使基金的净值增长率与业绩比较基准的收益率相一致。
投资策略	本基金将主要通过投资于大农业行业股票,并根据指数成份股及其权重的变动对投资组合进行相应的调整。
业绩比较基准	96%×中证大农业指数收益+4%×人民币兑美元汇率中间价
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高预期风险、较高预期收益特征,其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
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

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

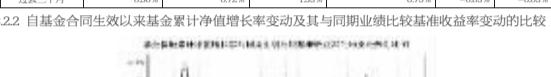
主要财务指标	报告期(2016年10月1日 - 2016年12月31日)
1.本期已实现收益	68,001.66
2.本期利润	89,462.09
3.加权平均基金份额本期利润	0.0008
4.期末基金资产净值	30,016,140.10
5.期末基金份额净值	1.004

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.本基金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 本基金份额净值增长率为及其与同期业绩比较基准收益率的比较



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



§ 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
何丽娟	融通深证100指数证券投资基金、融通深证100指数分级证券投资基金、融通中证全债证券投资基金、融通中证医药保健指数证券投资基金、融通中证大农业指数证券投资基金、融通创业板指数证券投资基金、融通健康产业指数证券投资基金、融通医疗保健行业股票型证券投资基金基金经理	2016年7月20日起至今	-	何丽娟先生,厦门大学经济学硕士,安信大摩资产管理有限公司投资总监,此前就职于泰康资产管理有限公司,历任投资经理、投资总监。2014年1月加入安信大摩资产管理有限公司,历任基金经理助理、基金经理,2015年11月起至今担任融通深证100指数证券投资基金基金经理,2016年1月起至今担任融通中证医药保健指数证券投资基金基金经理,2016年1月起至今担任融通中证大农业指数证券投资基金基金经理,2016年4月起至今担任融通创业板指数证券投资基金基金经理,2016年4月起至今担任融通健康产业指数证券投资基金基金经理,2016年4月起至今担任融通医疗保健行业股票型证券投资基金基金经理,2016年10月起至今担任融通医疗保健行业股票型证券投资基金基金经理,2016年10月起至今担任融通医疗保健行业股票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准计算标准。

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严格执行公平交易制度。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 报告期内基金投资额度和运作分析

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基金管理的核心思想,并将此原则贯彻于基金的运作之中。

本基金的运作策略。本基金运用量化选股策略,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。

4.5 公平交易专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

截至本报告期末,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)	占基金资产的比例(%)
1	权属投资	19,400,400.00	90.00
2	货币市场基金	8,200,000.00	3.67
3	短期投资	-	-
4	债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	回购协议	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,970,561.27	0.90
8	其他资产	24,211.00	0.11
9	合计	21,406,203.26	100.00

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.本基金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。

5.2 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	2,767,556.31
2.本期利润	-3,436,366.27
3.加权平均基金份额本期利润	-0.02564
4.期末基金资产净值	112,697.00
5.期末基金份额净值	1.0117

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.本基金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。

5.3 主要财务指标

单位:人民币元

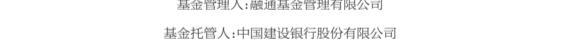
主要财务指标	报告期(2016年10月1日 - 2016年12月31日)
1.本期已实现收益	2,767,556.31
2.本期利润	-3,436,366.27
3.加权平均基金份额本期利润	-0.02564
4.期末基金资产净值	112,697.00
5.期末基金份额净值	1.0117

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.本基金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。

5.4 报告期内基金净值波动情况

本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



§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期初基金份额总额	21,406,203.26
报告期期间申购份数	33,644,222.38
减:报告期期间赎回份数	34,644,887.27
报告期期间基金分红份额	-
报告期末基金份额总额	20,603,540.37

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.本基金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。

5.5 投资组合报告

（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）融通基金管理有限公司服务资格批件和营业执照

（六）报告期在指定报刊上披露的各项公告

82.存放地点

基金管理人、基金托管人处。

83.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,或登陆本公司网站http://www.rtfund.com查询。

融通基金管理有限公司

融通中证军工指数分级证券投资基金

[2016]第四季度报告

基金管理人:融通基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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