融通可转债债券型证券投资基金

（原融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金）

2016年年度报告摘要

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，会议审议并于2016年12月9日表决通过了《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》。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，“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。

详细请参阅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、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，并出董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金（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 基金简介

2.1 基金基本情况

转型后

基金简称	融通可转债债券	
基金主代码	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	
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	74,880,966.04份	
基金合同存续期	不定期	
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	
基金主代码	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	
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	73,182,042.97份	
基金合同存续期	2013年3月26日至2016年12月8日	
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

2.2 基金产品说明

转型后

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、权证投资策略以及固债期货投资策略等部分。
业绩比较基准	中证可转债债券指数收益率*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。

转型前

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，按照成份存在权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，利用可转债具备股票和股票的特性，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	标普中证可转债价格指数×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。

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	徐卫东	林葛
	联系电话	（0755）26948966	（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	http://www.rtfund.com
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12月9日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	融通可转债债券A	融通可转债债券C
本期已实现收益	-49,607.87	-544,532.74
本期利润	-189,002.68	-2,043,052.93
加权平均基金份额本期利润	-0.0296	-0.0299
本期基金份额净值增长率	-3.26%	-3.29%
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	-0.1432	-0.1501
期末基金资产净值	5,546,459.75	58,137,980.55
期末基金份额净值	0.8568	0.8499

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)本期已实现收益是指本期利息收入、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(已实现部分非负数未实现部分)。

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12月8日		2015年		2014年	
	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	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	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
本期已实现收益	-1,259.196.26	-2,708.581.07	1,228,341.76	232,427.30	1,377,752.84	799,871.68
本期利润	-687,916.86	-532,997.55	-3,006.873.64	-8,372.562.00	13,561.484.84	8,017,442.28
加权平均基金份额本期利润	-0.1151	-0.0114	-0.2964	-0.3522	0.2220	0.2225
本期基金份额净值增长率	-11.83%	-12.97%	-28.54%	-28.44%	63.61%	63.16%
3.1.2 期末数据和指标	2016年12月8日		2015年末		2014年末	
期末可供分配基金份额利润	-0.1134	-0.1203	0.0058	0.0011	0.2044	0.1977
期末基金资产净值	4,361,656.89	60,049,704.77	6,070,715.02	13,963,831.52	22,996,826.07	19,406,228.95
期末基金份额净值	0.887	0.880	1.006	1.001	1.515	1.506

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)本期已实现收益是指本期利息收入、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(已实现部分非负数未实现部分)。

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

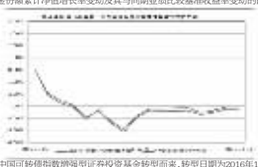
融通可转债债券A

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%

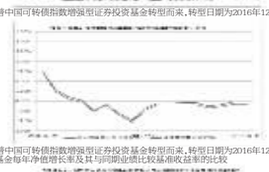
融通可转债债券C

阶段	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

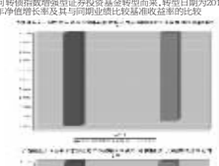


注:本基金由原融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金转型而来,转型日期为2016年12月9日。

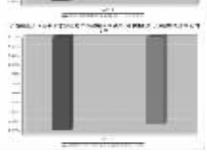


注:本基金由原融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金转型而来,转型日期为2016年12月9日。

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



转型前



转型后

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

融通标普中国可转债指数增强A					
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	-	-	-	-	-
2015	1.100	1,404,896.40	435,246.71	1,840,143.11	-
2014	-	-	-	-	-
合计	1.100	1,404,896.40	435,246.71	1,840,143.11	-

单位:人民币元

融通标普中国可转债指数增强C					
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	-	-	-	-	-
2015	1.100	2,145,913.28	453,061.36	2,598,974.64	-
2014	-	-	-	-	-
合计	1.100	2,145,913.28	453,061.36	2,598,974.64	-

转型后

单位:人民币元

融通可转债债券A					
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	-	-	-	-	-

单位:人民币元

融通可转债债券C					
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 基金管理人及其管理基金的经验

7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]89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 AssetManagement 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:田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、融通新先成长混合基金（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、融通丰利分级（ODII-POP）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、融通通津混合基金、融通通享混合基金、融通通福分级债券基金、融通通源短融债券基金、融通通信债券基金、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、融通新区成新经济混合基金、融通增利债券基金、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）、融通腾讯成长混合基金、融通新机遇混合基金、融通优选混合基金、融通通乐混合基金、融通通利混合基金、融通通悦债券基金、融通通安债券基金、融通通惠债券基金、融通增辉债券基金、融通通裕债券基金、融通通乐债券基金、融通通达债券基金、融通通顺债券基金、融通通金债券基金、融通通优债券基金、融通通乾债券基金、融通通利债券基金、融通通健债券基金、融通通福债券基金、融通通源短债基金、融通通盈债券基金、融通增益债券基金、融通增辉分级债券基金、融通通源混合基金、融通新趋势混合基金、融通通享混合基金、融通通福混合基金、融通通利混合基金、融通通悦混合基金、融通通安混合基金、融通通惠混合基金、融通通乐混合基金、融通通达混合基金、融通通顺混合基金、融通通金混合基金、融通通裕混合基金、融通通乐混合基金、融通通盈混合基金、融通通享混合基金、融通通福混合基金、融通通利混合基金、融通通悦混合基金、融通中证大农业指数基金（LOF）、融通腾讯成长混合基金、融通新机遇混合基金、融通优选混合基金、融通通乐