融通中证大农业指数证券投资基金（LOF） 2016年年度报告摘要

（原融通中证大农业指数分级证券投资基金）

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
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。	融通农业分级为稳健收益类份额，具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征。 融通农业B分级为积极收益类份额，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	徐卫东	林爽
	联系电话	（0755）26948666	(010)66060069
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	tgxxpl@abc.china.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 7月份数据和指标	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 7月末数据和指标	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）本期已实现收益是基金本期利息收入、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

	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
3.1.1 期间数据和指标		
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

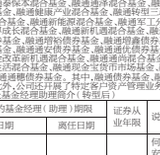
注:（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;
（2）本期已实现收益是基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;
（3）期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配利润;如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

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

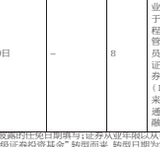
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.50%	0.72%	1.33%	0.75%	-0.83%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-1.76%	0.75%	-0.45%	0.78%	-1.31%	-0.03%

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



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



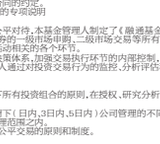
3.2基金净值表现（转型前）

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

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



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]81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:国融通新蓝筹混合基、融通债券基、融通深证100指数基金、融通蓝筹成长混合基、融通行业精选股票基金、融通巨潮100指数基金（LOF）、融通医疗保健混合基、融通证券投资基金（LOF）、融通医药保健股票基、融通深证成份指数基金、融通内需驱动混合基、融通保证金现金管理基金、融通创业板指数基金、融通医疗保健股票基、融通新兴产业股票基金、融通沪深300指数证券投资基金、融通中小盘成长混合基、融通稳健混合基、融通风格轮换混合基、融通稳健回报混合基、融通稳健增利债券基金、融通中证大农业指数证券投资基（LOF）、融通月月添利基金、融通健康产业股票基金、融通转型三动力混合基、融通互联网传媒混合基、融通新区域新经济混合基、融通通鑫混合基、融通新能源混合基、融通平安力强股票基金、融通证券分级指数基金、融通中证大农业指数证券投资基金（LOF）、融通深证成份混合基、融通成长混合基、融通新机遇混合基、融通优质混合基、融通成长价值混合基、融通成长动力混合基、融通通保灵活配置混合基、融通增利债券基金、融通稳健债券基、融通增利债券基、融通增强债券基、融通增益债券基、融通消费混合基、融通增利债券基、融通增长债券基、融通成长债券基、融通通宝债券基、融通通收益债券基、融通新经济混合基、融通增强混合基、融通增强债券基、融通成长混合基、融通成长优选混合基、融通通收益债券基、融通通利债券基、融通通利债券基、融通沪港深智慧生活混合基、融通现金宝货币市场基金、融通通利债券基金、融通稳健债券基金、融通通宝货币基金、融通通利债券基、融通通宝货币基金、融通通利债券基、融通通宝货币基金、融通通利债券基