融通可转债债券型证券投资基金

2017年第三季度报告

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10月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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10月24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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通可转债债券
交易代码	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
报告期末基金份额总额	74,234,676.97份
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、权证投资策略以及国债期货投资策略等部分。
业绩比较基准	中证可转换债券指数收益率*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。
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
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	4,936,351.50份	69,298,325.47份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年7月1日-2017年9月30日)	
	融通可转债债券A	融通可转债债券C
1. 本期已实现收益	-24,314.29	-410,461.48
2. 本期利润	134,826.46	2,027,294.39
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0291	0.0292
4. 期末基金资产净值	4,416,850.82	61,316,973.48
5. 期末基金份额净值	0.8948	0.8848

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、本报告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 本报告期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

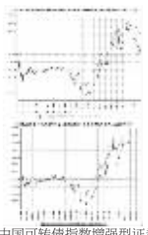
融通可转债债券A

阶段	净值增长率①	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	3.61%	0.58%	3.42%	0.43%	0.19%	0.15%

融通可转债债券C

阶段	净值增长率①	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	3.50%	0.58%	3.42%	0.43%	0.08%	0.15%

3.2.2 自基金转型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



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,截至报告期末,本基金转型未满一年。

§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
		任职日期	离任日期		
王超	本基金的基金经理、固定收益部总监	2016年12月9日	-	10	王超先生,金融工程硕士,经济学、数学双学士,10年证券投资从业经历,具有基金从业资格,现任融通基金管理有限公司固定收益部总监。历任深圳发展银行(现更名为平安银行)债券自营交易盘投资与理财投资管理经理。2012年8月加入融通基金管理有限公司,现任融通可转债债券(由原融通标普中国可转债指数基金转型而来)、融通债券、融通四季添利债券(LOF)、融通岁岁添利定期开放债券、融通增鑫债券、融通增益债券、融通增裕债券、融通通泰保本、融通增丰债券、融通现金宝货币、融通稳利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。

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 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保证公平交易制度的严格执行。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 报告期内基金投资策略和运作分析

7月周期股和金融股持续上涨带动中证转债指数单边上涨、一举突破300点并抵达年内次高点311,转债平均估值水平上扬,转股溢价率由月初的29%上行至月末的31%;进入8月,周期股和金融股转跌,转债指数也连降两周至302,随后8月中旬股市开始演绎中报行情,叠加十九大维稳预期和人民币走强等利好提振市场信心,周期金融再度发力,上证综指连续上涨并在月末站上3300,期间转债跟随正股上涨,同时估值提升带动转债指数冲高至年内高点314;9月因转债申购新规落地,转债放量在即、投资者获利了结倾向加大,转债市场估值均值由月初的33%压缩至31%,同时9月股票市场呈现震荡向下格局,叠加债市资金面偏紧,转债指数在正股、流动性和估值三重压力下单边下跌至300。

投资方面,本基金保持了组合的稳定,适度提升了金融转债比例,降低了股票投资比例。

展望四季度,预计经济增速边际下滑,盈利预期有可能低于三季度,流动性预期在实体降杠杆、金融防风险、地产调控背景下改善空间有限,同时四季度解禁压力偏高,且市场在十九大会议结束后维稳诉求降低,预计四季度市场的不确定性大于三季度,股市难有趋势性行情,转债预计也难有趋势性机会,投资的核心依据仍是正股基本面,选择正股基本面良好的中高平价转债,避开新券替代效应强、筹码价值弱化的中低平价转债和同一行业内正股资质落差明显的转债。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通可转债债券A基金份额净值为0.8948元,本报告期基金份额净值增长率为3.61%;截至本报告期末融通可转债债券C基金份额净值为0.8848元,本报告期基金份额净值增长率为3.50%;同期业绩比较基准收益率为4.74%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者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	6,512,500.00	8.44
	其中:股票	6,512,500.00	8.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	68,878,341.86	89.30
	其中:债券	68,878,341.86	89.30
	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	1,487,439.37	1.93
8	其他资产	249,890.46	0.32
9	合计	77,128,171.69	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,902,200.00	4.42
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	3,610,300.00	5.49
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	6,512,500.00	9.91

5.3 报告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

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	601398	工商银行	400,000	2,400,000.00	3.65
2	002534	杭锅股份	180,000	2,122,200.00	3.23
3	601166	兴业银行	70,000	1,210,300.00	1.84
4	601311	骆驼股份	50,000	780,000.00	1.19

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	3,298,350.00	5.02
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	4,742,900.00	7.22
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	60,837,091.86	92.55
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	68,878,341.86	104.78

5.5 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	113011	光大转债	260,000	28,969,200.00	44.07
2	110032	三一转债	50,000	5,903,000.00	8.98
3	113013	国君转债	44,470	5,569,422.80	8.47
4	113008	电气转债	50,000	5,323,500.00	8.10
5	123001	蓝标转债	33,602	3,540,978.76	5.39

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末持有国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,023.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	185,043.02
5	应收申购款	58,824.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	249,890.46

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113011	光大转债	28,969,200.00	44.07
2	110032	三一转债	5,903,000.00	8.98
3	113008	电气转债	5,323,500.00	8.10
4	123001	蓝标转债	3,540,978.76	5.39
5	110033	国贸转债	2,205,180.00	3.35
6	110034	九州转债	2,182,592.20	3.32
7	113009	广汽转债	1,773,940.00	2.70
8	128010	顺昌转债	1,413,720.00	2.15
9	113010	江南转债	1,331,568.00	2.03
10	128012	辉丰转债	1,026,500.00	1.56
11	127003	海印转债	1,011,600.00	1.54
12	128013	洪涛转债	585,890.10	0.89

5.10.5 报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	融通可转债债券A	融通可转债债券C
报告期期初基金份额总额	4,333,137.12	68,479,696.37
报告期期间基金总申购份额	1,753,208.90	6,654,396.44
减:报告期期间基金总赎回份额	1,149,994.52	5,835,767.34
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	4,936,351.50	69,298,325.47

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170701-20170930	58,004,640.38	0.00	0.00	58,004,640.38	78.14%
个人			-	-	-	-	-
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时,可能存在因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金单位份额净值剧烈波动的风险及流动性风险。							

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)《融通基金管理有限公司关于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表决结果暨决议生效的公告》

(二)中国证监会批准标普中国可转债指数增强型证券投资基金变更注册的批复

(三)《融通可转债债券型证券投资基金基金合同》

(四)《融通可转债债券型证券投资基金托管协议》

(五)《融通可转债债券型证券投资基金招募说明书》及其更新

(六)中国证监会批准融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金设立的文件

(七)报告期内在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

9.3 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,或登陆本基金管理人网站http://www.rtfund.com查询。

融通基金管理有限公司
2017年10月26日

融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)

2017年第三季度报告

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10月26日

§1 0重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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10月24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,投资者在做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2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通领先成长混合(LOF)
场内简称	融通领先
交易代码	161610
前端交易代码	161610
后端交易代码	161660
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年4月30日
报告期末基金份额总额	3,737,716,827.81份
投资目标	本基金主要投资于业绩能持续高速增长的上市公司,通过积极主动的分散化投资策略,在严格控制风险的前提下实现基金资产的持续增长,为基金持有人获取长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金认为股价上升的主要推动力来自于企业盈利的不断增长。在中国经济长期高速增长的大背景下,许多企业在一定时期表现出较高的成长性,但只有符合产业结构发展趋势,同时在技术创新、经营模式、品牌、渠道、成本等方面具有领先优势的企业,才能保持业绩持续高速成长,而这些企业正是本基金重点投资的目标和获得长期超额回报的基础。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中债综合全价(总值)指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金是较高预期收益较高预期风险的产品,其预期收益与风险高于混合基金、债券基金与货币市场基金。
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年7月1日-2017年9月30日)
1.本期已实现收益	37,758,099.62
2.本期利润	180,816,191.52
3.加权平均基金份额本期利润	0.0469
4.期末基金资产净值	3,581,454,551.45
5.期末基金份额净值	0.958

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。

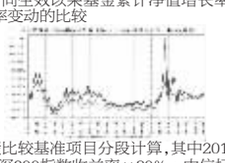
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	5.16%	0.92%	3.67%	0.47%	1.49%	0.45%

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



注:本基金业绩比较基准项目分段计算,其中2015年9月30日之前(含此日)采用"沪深300指数收益率×80%+中信标普全债指数收益率×20%。",2015年10月1日起使用新基准即"沪深300指数收益率×80%+中债综合全价(总值)指数收益率×20%"。

§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
		任职日期	离任日期		
邹曦	本基金的基金经理、权益投资总监	2017年2月18日	-	16	邹曦先生,中国人民银行研究生部金融学硕士、北京航空航天大学工程学学士,16年证券投资从业经历,具有基金从业资格,现任融通基金管理有限公司权益投资总监。2001年2月加入融通基金管理有限公司,历任融通基金管理有限公司市场拓展部总监助理、机构理财部总监助理、行业分析师、宏观策略分析师、基金管理部总监、研究部总监,现任融通行业景气混合、融通领先成长混合(LOF)基金的基金经理
伍文友	本基金的基金经理	2015年8月29日	-	7	伍文友先生,中国人民银行研究部金融学硕士、中国科学技术大学金融学学士,7年证券投资从业经历,具有基金从业资格。历任中国人寿资产管理有限公司助理研究员、建信基金管理有限公司研究员,2015年5月加入融通基金管理有限公司,现任融通领先成长混合(LOF)、融通互联网传媒灵活配置混合基金的基金经理。

注:任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写;证券从业年限以从事证券业务相关的工作时间为计算标准。

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 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保证公平交易制度的严格执行。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 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金的主要投资策略是围绕经济转型和消费升级的大背景,寻找中长期成长趋势确定性较强以及景气拐点向上的行业及个股。一方面,坚持自下而上精选个股,按照行业景气度、细分市场空间、企业战略、管理层执行力、企业竞争力等角度,挖掘优质成长个股;另一方面,从行业政策导向、竞争格局、供需结构、景气度等角度把握板块轮动的投资机会,以此获得中长期投资回报。

2017年前三季度,相关数据表明我国经济已经逐步企稳,中长期底部特征比较明显,部分行业的景气拐点已经出现,相关企业的盈利水平得到明显改善。同时,随着供给侧改革、国企改革、"一带一路"战略的逐步推进,市场对我国经济中长期发展的信心在不断增强。货币政策方面,松紧适度,为稳增长和促改革提供了较好的环境。汇率方面,合理引导市场预期,积极维护外汇市场稳定,预期管理的效果较好。财政政策方面,稳增长已初显成效,PPP(公私合营)仍在规范中稳步推进。二季度以来,金融政策和PPP(公私合营)均有强化监管的迹象,但是对市场的短期情绪影响已经弱化,并且奠定了市场中长期健康发展的基石,也从侧面显示出了决策层对于经济基本面的信心。中长期来看,改革、转型、升级和创新仍然是我国经济发展的主线。

2017年三季度,证券市场继续向价值投资回归,对于业绩确定性及行业景气度的偏好继续提升,因此行业及公司的内生性成长及盈利能力是关键,同时还要求合理的估值即"好价格"。我们继续围绕"好行业"、"好公司"和"好价格"这三个核心要素进行行业和个股选择。我们认为,中长期成长性比较确定的行业包括新消费、新材料、半导体、精品内容制作、节能环保、高端制造、军民融合等,中期比较确定的投资机会可能来自于供需改善下的景气改善板块,以及受益于宏观经济及证券市场双双企稳的金融板块等。我们认为供给侧改革有利于从中长期角度扭转产能过剩的局面,部分传统行业的景气拐点已经出现并且能够持续,其中的优质企业有望获得更多的市场份额;同时,我们更加期待以增加有效供给满足潜在需求的供给侧改革。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.9580元;本报告期基金份额净值增长率为5.16%,业绩比较基准收益率为3.67%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者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	3,400,604,253.66	94.42
	其中:股票	3,400,604,253.66	94.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,720,677.37	0.05
	其中:债券	1,720,677.37	0.05
	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	192,029,855.37	5.33
8	其他资产	7,230,708.66	0.20
9	合计	3,601,585,495.06	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	28,886,957.78	0.81
B	采矿业	437,600,000.75	12.22
C	制造业	1,914,827,671.05	53.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.00
E	建筑业	37,363,925.72	1.04
F	批发和零售业	140,150,520.82	3.91
G	交通运输、仓储和邮政业	34,664,921.67	0.97
H	住宿和餐饮业	15,375,041.40	0.43
I	信息传输、软件和信息技术服务业	157,010,961.70	4.38
J	金融业	87,313,337.48	2.44
K	房地产业	72,881,664.92	2.03
L	租赁和商务服务业	235,195,441.11	6.57
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	24,268,060.08	0.68
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,382,225.99	0.46
R	文化、体育和娱乐业	198,652,429.75	5.55
S	综合	-	-
	合计	3,400,604,253.66	94.95

5.3 报告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

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	601888	中国国旅	5,874,878	202,624,542.22	5.66
2	002343	慈文传媒	5,130,675	198,608,429.25	5.55
3	601225	陕西煤业	17,021,548	149,789,622.40	4.18
4	000983	西山煤电	12,961,061	133,628,538.91	3.73
5	600809	马钢股份	28,993,912	133,371,995.20	3.72
6	600276	恒瑞医药	2,083,218	124,847,254.74	3.49
7	600801	华新水泥	6,352,514	91,666,777.02	2.56
8	300136	信维通信	1,860,975	78,160,950.00	2.18
9	002475	立讯精密	3,611,895	74,621,750.70	2.08
10	002008	大族激光	1,694,951	73,899,863.60	2.06

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	1,720,677.37	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,720,677.37	0.05

5.5 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	128016	雨虹转债	17,207	1,720,677.37	0.05

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内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、处罚的情形:

2017年8月15日,西山煤电公告收到山西省发展和改革委员会《行政处罚决定书》(晋发改价监处[2017]13号)。依据《中华人民共和国反垄断法》第四十六条、第四十九条和《中华人民共和国行政处罚法》第二十七条的规定,对公司所属电厂按2016年度相关销售额1%处以罚款,计505.3216万元(大写:伍佰零伍万叁仟贰佰壹拾陆元整)。该事项对公司无重大影响,公司目前生产经营活动一切正常。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	783,132.26
2	应收证券清算款	6,138,944.84
3	应收股利	-
4	应收利息	37,664.74
5	应收申购款	270,966.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,230,708.66

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	3,963,535,566.12
报告期期间基金总申购份额	21,479,645.29
减:报告期期间基金总赎回份额	247,298,383.60
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	3,737,716,827.81

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	12,253,508.07
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	12,253,508.07
报告期期末管理人持有的本基金份额	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	场内赎回	2017-9-19	-8,244,122.00	-7,718,930.21	0.50%
2	直销赎回	2017-9-19	-4,009,386.07	-3,772,832.29	-
合计	-	-	-12,253,508.07	-11,491,762.50	-

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(一)中国证监会《关于核准通宝证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》

(二)《融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》

(三)《融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)托管协议》

(四)《融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)招募说明书》及其定期更新

(五)《融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)上市交易公告书》

(六)融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处、深圳证券交易所。

8.3 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,或登陆本基金管理人网站http://www.rtfund.com查询。

融通基金管理有限公司
2017年10月26日

融通四季添利债券型证券投资基金

2017年第三季度报告

基金管理人:融通基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月23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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通四季添利债券(LOF)
场内简称	融通添利
交易代码	161614
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月1日
报告期末基金份额总额	857,585,651.49份
投资目标	在严格控制投资风险的基础上,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将在基金合同约定的投资范围内,通过对宏观经济运行状况的研究,积极的调整和优化固定收益类金融工具的资产比例配置。在有效控制风险的基础上,获得基金资产的稳定增值。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金属于债券基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金、股票型基金。
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年7月1日-2017年9月30日)
1.本期已实现收益	6,974,294.18
2.本期利润	5,274,409.47
3.加权平均基金份额本期利润	0.0057
4.期末基金资产净值	886,144,581.29
5.期末基金份额净值	1.033

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