

融通通利系列证券投资基金之融通深证100指数证券投资基金 2017年第1季度报告 2017年3月31日

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4月21日

重要提示 融通通利系列证券投资基金由融通债券投资基金、融通深证100指数证券投资基金和融通蓝筹成长证券投资基金共同构成。本报告为融通通利系列证券投资基金之融通深证100指数证券投资基金(以下简称“本基金”)2017年第1季度报告。

基金管理人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。 基金托管人中国工商银行股份有限公司根据《融通通利系列证券投资基金基金合同》规定,于2017年4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。

本报告自2017年1月1日起至2017年3月31日止。 \$2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称, 融通深证100指数; 交易代码, 161604; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日, 2003年9月30日; 报告期末基金份额总额, 4,212,820,585.04份; 投资策略, 以债券资产90%以上的资产对深证100指数的成份股进行投资; 业绩比较基准, 深证100指数收益率*95%+银行同业存款利率*5%; 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

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日); 1.本期已实现收益, 97,091,058.21; 2.本期利润, 261,918,542.95; 3.加权平均基金份额本期利润, 0.0614; 4.期末基金资产净值, 5,430,390,511.22; 5.期末基金份额净值, 1.289

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

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益差③, 业绩比较基准收益差标准差④; 过去三个月, 4.98%, 0.74%, 0.75%, 0.75%

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的比较

注:本基金业绩比较基准项目分段计算,其中:2005年8月21日之前(含此日)采用“深证100指数*75%+银行间债券综合指数*25%”,2005年8月22日起使用新基准即“深证100指数收益率*95%+银行同业存款利率*5%”。

\$4 管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限(任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明; 何天翔先生, 本基金的基金经理, 2014年10月25日, 8, 何天翔先生,厦门大学经济学硕士,安徽大学理学学士,8年证券投资从业经历,具有基金从业资格...

注:任免日期指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,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为,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 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本基金管理的核心思想,并将此原则贯彻于基金的运作始终。本基金运用指数化投资策略,通过控制股票投资组合与深证100指数成份股自然权重的偏离,有效控制跟踪误差,为投资者提供投资深证100指数的一个有效工具。

本报告期内,本基金日均跟踪偏离为0.03%,年化跟踪误差为0.72%,符合基金合同约定。 4.5 报告期内基金的业绩表现 本报告期基金份额净值增长率为4.98%,同期业绩比较基准收益率为5.39%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 无。

\$5 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元); 1 权益投资, 5,150,750,046.51; 2 基金投资, -; 3 固定收益投资, 214,025,507.60; 4 贵金属投资, -; 5 金融衍生品投资, -; 6 买入返售金融资产, -; 7 银行存款和结算备付金合计, 66,809,328.37; 8 其他资产, 14,358,818.15; 9 合计, 5,445,943,700.63

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

Table with 4 columns: 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, 184,332,770.40; B 采矿业, 28,014,857.10; C 制造业, 2,940,076,133.60; D 电力、热力、燃气及水生产和供应业, -; E 建筑业, 61,198,700.78; F 批发和零售业, 76,521,380.40; G 交通运输、仓储和邮政业, -; H 住宿和餐饮业, -; I 信息技术、软件和信息技术服务业, 531,436,781.97; J 金融业, 688,188,132.67; K 房地产业, 299,273,650.85; L 租赁和商务服务业, 49,753,302.66; M 科学研究和技术服务业, -; N 水利、环境和公共设施管理业, 125,211,127.24; O 教育服务、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, 133,138,360.01; S 综合, 33,604,372.83; 合计, 5,150,750,046.51

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合 本基金本报告期末无积极投资部分股票。

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

Table with 5 columns: 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 000651 格力电器, 8,912,339, 282,521,146.30; 2 000333 美的集团, 8,210,557, 273,411,548.10; 3 300498 蓝晓股份, 5,609,640, 184,332,770.40; 4 000002 万科A, 7,740,100, 159,291,258.00; 5 000858 五粮液, 3,451,039, 148,433,377.00; 6 000725 京东方A, 41,985,067, 144,428,304.48; 7 000001 平安银行, 15,470,021, 141,860,925.57; 8 002415 海康威视, 3,641,912, 114,676,929.80; 9 000776 广发证券, 5,619,456, 96,036,503.04; 10 002204 洋河股份, 1,008,933, 88,160,565.54

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细 本基金本报告期末无积极投资部分股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1 国债债券, 14,145,507.60, 0.26; 2 央行票据, -; 3 金融债券, 199,880,000.00, 3.68; 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), -; 8 其他, -; 9 合计, 214,025,507.60, 3.94

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

Table with 5 columns: 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 160414 16农发14, 2,000,000, 199,880,000.00; 2 019539 16国债11, 141,540, 14,145,507.60

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股指期货交易情况说明 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细 本基金本报告期末未持有股指期货。 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策 本基金本报告期末未投资股指期货。 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 5.10.1 本期国债期货投资政策 本基金本报告期末未投资国债期货。 5.10.2 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。 5.10.3 本期国债期货投资评价 本基金本报告期末未投资国债期货。 5.11 投资组合报告附注 5.11.1 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、处罚情况 广发证券 2016年11月26日,广发证券收到中国证监会《行政处罚决定书》(2016)128号。中国证监会根据当事人违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度,依据《证券公司监督管理条例》第八十四条的规定对广发证券责令改正,给予警告,没收违法所得6,805,135.75元,并处以20,415,407.25元罚款。

5.11.2 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。 5.11.3 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元); 1 存出保证金, 84,130.68; 2 应收证券清算款, 5,117,449.26; 3 应收股利, -; 4 应收利息, 5,209,819.02; 5 应收申购款, 3,947,419.19; 6 其他应收款, -; 7 待摊费用, -; 8 其他, -; 9 合计, 14,358,818.15

注:本基金A类基金份额业绩比较基准项目分段计算,其中:2009年12月31日(含此日)之前采用“银行间债券综合指数”,2010年1月1日起至2015年9月30日(含此日)采用“中信标普全债指数收益率”,2015年10月1日起采用新基准“中债综合全价(总值)指数收益率”;本基金C类基金份额业绩比较基准项目分段计算,其中:2012年2月20日(含此日)之前采用“中信标普全债指数收益率”,2015年10月1日起采用新基准“中债综合全价(总值)指数收益率”。

\$4 管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限(任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明; 王珏先生, 基金经理, 2013年12月27日, 9, 王珏先生,金融工程硕士,经济学、数学双学士,9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副总监,历任深圳发展银行(现更名为平安银行)零售自营交易与投资与管理助理经理,融通债券、融通四季利债券(OFC)、融通步步高定期开放债券、融通海富债券、融通瑞福债券、融通瑞增债券、融通海富保本、融通增利债券、融通现金宝货币、融通利利债券的基金经理。

注:任免日期指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,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为,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 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本基金管理的核心思想,并将此原则贯彻于基金的运作始终。本基金运用指数化投资策略,通过控制股票投资组合与深证100指数成份股自然权重的偏离,有效控制跟踪误差,为投资者提供投资深证100指数的一个有效工具。

本报告期内,本基金日均跟踪偏离为0.03%,年化跟踪误差为0.72%,符合基金合同约定。 4.5 报告期内基金的业绩表现 本报告期基金份额净值增长率为4.98%,同期业绩比较基准收益率为5.39%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 无。

\$5 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元); 1 权益投资, 5,150,750,046.51; 2 基金投资, -; 3 固定收益投资, 214,025,507.60; 4 贵金属投资, -; 5 金融衍生品投资, -; 6 买入返售金融资产, -; 7 银行存款和结算备付金合计, 66,809,328.37; 8 其他资产, 14,358,818.15; 9 合计, 5,445,943,700.63

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

Table with 4 columns: 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, 184,332,770.40; B 采矿业, 28,014,857.10; C 制造业, 2,940,076,133.60; D 电力、热力、燃气及水生产和供应业, -; E 建筑业, 61,198,700.78; F 批发和零售业, 76,521,380.40; G 交通运输、仓储和邮政业, -; H 住宿和餐饮业, -; I 信息技术、软件和信息技术服务业, 531,436,781.97; J 金融业, 688,188,132.67; K 房地产业, 299,273,650.85; L 租赁和商务服务业, 49,753,302.66; M 科学研究和技术服务业, -; N 水利、环境和公共设施管理业, 125,211,127.24; O 教育服务、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, 133,138,360.01; S 综合, 33,604,372.83; 合计, 5,150,750,046.51

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合 本基金本报告期末无积极投资部分股票。

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

Table with 5 columns: 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 000651 格力电器, 8,912,339, 282,521,146.30; 2 000333 美的集团, 8,210,557, 273,411,548.10; 3 300498 蓝晓股份, 5,609,640, 184,332,770.40; 4 000002 万科A, 7,740,100, 159,291,258.00; 5 000858 五粮液, 3,451,039, 148,433,377.00; 6 000725 京东方A, 41,985,067, 144,428,304.48; 7 000001 平安银行, 15,470,021, 141,860,925.57; 8 002415 海康威视, 3,641,912, 114,676,929.80; 9 000776 广发证券, 5,619,456, 96,036,503.04; 10 002204 洋河股份, 1,008,933, 88,160,565.54

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细 本基金本报告期末无积极投资部分股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1 国债债券, 14,145,507.60, 0.26; 2 央行票据, -; 3 金融债券, 199,880,000.00, 3.68; 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), -; 8 其他, -; 9 合计, 214,025,507.60, 3.94

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

Table with 5 columns: 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 160414 16农发14, 2,000,000, 199,880,000.00; 2 019539 16国债11, 141,540, 14,145,507.60

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股指期货交易情况说明 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细 本基金本报告期末未持有股指期货。 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策 本基金本报告期末未投资股指期货。 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 5.10.1 本期国债期货投资政策 本基金本报告期末未投资国债期货。 5.10.2 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。 5.10.3 本期国债期货投资评价 本基金本报告期末未投资国债期货。 5.11 投资组合报告附注 5.11.1 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、处罚情况 广发证券 2016年11月26日,广发证券收到中国证监会《行政处罚决定书》(2016)128号。中国证监会根据当事人违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度,依据《证券公司监督管理条例》第八十四条的规定对广发证券责令改正,给予警告,没收违法所得6,805,135.75元,并处以20,415,407.25元罚款。

5.11.2 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。 5.11.3 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元); 1 存出保证金, 84,130.68; 2 应收证券清算款, 5,117,449.26; 3 应收股利, -; 4 应收利息, 5,209,819.02; 5 应收申购款, 3,947,419.19; 6 其他应收款, -; 7 待摊费用, -; 8 其他, -; 9 合计, 14,358,818.15

注:本基金A类基金份额业绩比较基准项目分段计算,其中:2009年12月31日(含此日)之前采用“银行间债券综合指数”,2010年1月1日起至2015年9月30日(含此日)采用“中信标普全债指数收益率”,2015年10月1日起采用新基准“中债综合全价(总值)指数收益率”;本基金C类基金份额业绩比较基准项目分段计算,其中:2012年2月20日(含此日)之前采用“中信标普全债指数收益率”,2015年10月1日起采用新基准“中债综合全价(总值)指数收益率”。

\$4 管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限(任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明; 王珏先生, 基金经理, 2013年12月27日, 9, 王珏先生,金融工程硕士,经济学、数学双学士,9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副总监,历任深圳发展银行(现更名为平安银行)零售自营交易与投资与管理助理经理,融通债券、融通四季利债券(OFC)、融通步步高定期开放债券、融通海富债券、融通瑞福债券、融通瑞增债券、融通海富保本、融通增利债券、融通现金宝货币、融通利利债券的基金经理。

注:任免日期指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,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为,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 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本基金管理的核心思想,并将此原则贯彻于基金的运作始终。本基金运用指数化投资策略,通过控制股票投资组合与深证100指数成份股自然权重的偏离,有效控制跟踪误差,为投资者提供投资深证100指数的一个有效工具。

本报告期内,本基金日均跟踪偏离为0.03%,年化跟踪误差为0.72%,符合基金合同约定。 4.5 报告期内基金的业绩表现 本报告期基金份额净值增长率为4.98%,同期业绩比较基准收益率为5.39%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 无。

\$5 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元); 1 权益投资, 5,150,750,046.51; 2 基金投资, -; 3 固定收益投资, 214,025,507.60; 4 贵金属投资, -; 5 金融衍生品投资, -; 6 买入返售金融资产, -; 7 银行存款和结算备付金合计, 66,809,328.37; 8 其他资产, 14,358,818.15; 9 合计, 5,445,943,700.63

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

Table with 4 columns: 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, 184,332,770.40; B 采矿业, 28,014,857.10; C 制造业, 2,940,076,133.60; D 电力、热力、燃气及水生产和供应业, -; E 建筑业, 61,198,700.78; F 批发和零售业, 76,521,380.40; G 交通运输、仓储和邮政业, -; H 住宿和餐饮业, -; I 信息技术、软件和信息技术服务业, 531,436,781.97; J 金融业, 688,188,132.67; K 房地产业, 299,273,650.85; L 租赁和商务服务业, 49,753,302.66; M 科学研究和技术服务业, -; N 水利、环境和公共设施管理业, 125,211,127.24; O 教育服务、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, 133,138,360.01; S 综合, 33,604,372.83; 合计, 5,150,750,046.51

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合 本基金本报告期末无积极投资部分股票。

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

Table with 5 columns: 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 000651 格力电器, 8,912,339, 282,521,146.30; 2 000333 美的集团, 8,210,557, 273,411,548.10; 3 300498 蓝晓股份, 5,609,640, 184,332,770.40; 4 000002 万科A, 7,740,100, 159,291,258.00; 5 000858 五粮液, 3,451,039, 148,433,377.00; 6 000725 京东方A, 41,985,067, 144,428,304.48; 7 000001 平安银行, 15,470,021, 141,860,925.57; 8 002415 海康威视, 3,641,912, 114,676,929.80; 9 000776 广发证券, 5,619,456, 96,036,503.04; 10 002204 洋河股份, 1,008,933, 88,160,565.54

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细 本基金本报告期末无积极投资部分股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1 国债债券, 14,145,507.60, 0.26; 2 央行票据, -; 3 金融债券, 199,880,000.00, 3.68; 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), -; 8 其他, -; 9 合计, 214,025,507.60, 3.94

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

Table with 5 columns: 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 160414 16农发14, 2,000,000, 199,880,000.00; 2 019539 16国债11, 141,540, 14,145,507.60

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股指期货交易情况说明 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细 本基金本报告期末未持有股指期货。 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策 本基金本报告期末未投资股指期货。 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 5.10.1 本期国债期货投资政策 本基金本报告期末未投资国债期货。 5.10.2 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。 5.10.3 本期国债期货投资评价 本基金本报告期末未投资国债期货。 5.11 投资组合报告附注 5.11.1 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、处罚情况 广发证券 2016年11月26日,广发证券收到中国证监会《行政处罚决定书》(2016)128号。中国证监会根据当事人违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度,依据《证券公司监督管理条例》第八十四条的规定对广发证券责令改正,给予警告,没收违法所得6,805,135.75元,并处以20,415,407.25元罚款。

5.11.2 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。 5.11.3 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元); 1 存出保证金, 84,130.68; 2 应收证券清算款, 5,117,449.26; 3 应收股利, -; 4 应收利息, 5,209,819.02; 5 应收申购款, 3,947,419.19; 6 其他应收款, -; 7 待摊费用, -; 8 其他, -; 9 合计, 14,358,818.15

注:本基金A类基金份额业绩比较基准项目分段计算,其中:2009年12月31日(含此日)之前采用“银行间债券综合指数”,2010年1月1日起至2015年9月30日(含此日)采用“中信标普全债指数收益率”,2015年10月1日起采用新基准“中债综合全价(总值)指数收益率”;本基金C类基金份额业绩比较基准项目分段计算,其中:2012年2月20日(含此日)之前采用“中信标普全债指数收益率”,2015年10月1日起采用新基准“中债综合全价(总值)指数收益率”。

\$4 管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限(任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明; 王珏先生, 基金经理, 2013年12月27日, 9, 王珏先生,金融工程硕士,经济学、数学双学士,9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副总监,历任深圳发展银行(现更名为平安银行)零售自营交易与投资与管理助理经理,融通债券、融通四季利债券(OFC)、融通步步高定期开放债券、融通海富债券、融通瑞福债券、融通瑞增债券、融通海富保本、融通增利债券、融通现金宝货币、融通利利债券的基金经理。