信达澳银产业升级混合型证券投资基金

2017 第二季度 报告

2017年6月30日

基金管理人:信达澳银基金管理有限公司
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7月21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7月20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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信达澳银产业升级混合
基金主代码	610006
交易代码	610006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年6月13日
报告期末基金份额总额	181,654,170.26份
投资目标	把握经济结构调整中的传统产业升级和新兴产业发展的战略性机遇,精选受益于产业升级和新兴产业发展的个股,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金以中国经济转型过程中传统产业升级和新兴产业发展作为投资主线,并通过"自上而下"和"自下而上"相结合的方法构建基金的资产组合。一方面,本基金通过"自上而下"的深入分析,在对国内外宏观经济发展趋势、国家相关政策深入研究的基础上,优化大类资产配置,甄选受益行业;另一方面,通过"自下而上"的深入分析精选公司素质高、核心竞争力突出、治理合理的公司,在整个行业的出色能力来抵御行业的不确定性和各种压力,力争获得超越行业平均水平的良好回报。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是混合型基金产品,基金资产整体的预期收益和预期风险均较高,属于较高风险、较高收益的基金品种。
基金管理人	信达澳银基金管理有限公司
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4月1日 — 2017年6月30日)
1.本期已实现收益	-19,129,389.84
2.本期利润	-17,283,140.10
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0930
4.期末基金资产净值	233,891,733.04
5.期末基金份额净值	1.288

注:1、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的认购、申购及赎回费等),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。

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	-6.67%	0.99%	4.84%	0.50%	-11.51%	0.49%

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:1、本基金基金合同于2011年6月13日生效,2011年7月11日开始办理申购、赎回业务。

2、本基金的投资组合比例为:股票等权益类资产为基金资产的60%-95%,债券等固定收益类资产及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的5%-40%,权证占基金资产净值的0%-3%,基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%;基金投资受益于产业升级的股票不低于股票资产的80%。本基金按规定在合同生效后六个月内达到上述规定的投资比例。

§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		
曾智富	本基金的基金经理;公募投资总部副总监	2015年2月14日	-	18年	上海财经大学管理学硕士,1994年至2005年历任星河大华会计师事务所审计部经理,大鹏证券有限责任公司投资银行部业务董事,内部审核委员会委员,平安证券有限责任公司资本市场事业部业务总监,内部审核委员会委员,国海富兰克林基金管理有限公司研究分析部分析员,2006年9月加入信达澳银基金,历任高级分析师,投资副总监,投资研究部下投资投资副总经理,研究副总监,研究总监,公募投资总部副总监,信达澳银特许配置混合基金基金经理(2008年7月30日至2011年12月16日),信达澳银中小盘混合基金基金经理(2009年12月1日至2014年2月22日),信达澳银产业升级混合基金基金经理(2015年2月14日起至今)。

注:1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益,没有发生损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已经建立了投资决策及交易内控制度,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,维护投资者的利益。本基金管理人建立了严谨的公平交易机制,确保不同基金在买卖同一证券时,按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司对报告期内公司所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行了分析;利用数据统计和重点审查价差原因相结合的方法,对连续四个季度内、不同时间窗口(日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易价差进行了分析;对部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易进行了审核和监控,未发现公司所管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为,报告期内本公司所管理的投资组合未发生交易所公开竞价的同日反向交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2季度,在经济增长总体好转情况下,受监管环境变化、流动性收紧等因素影响,市场总体呈现震荡走势,但结构上分化剧烈,沪深300、上证50录得不错的涨幅,而其他指数大多下跌。家电、食品饮料行业均保持年初以来的上涨态势,获得了较大的上涨幅度。

总体而言,本基金主要是在坚持自下而上投资策略的基础上,仍采用把握波段,精选个股的投资策略进行操作。但因更多的配置仍在成长股及自下而上选择的个股上,造成报告期间本基金净值跑输了基金比较基准较多。

展望未来一段时间,预计经济增长将有所回落,但监管环境趋严、流动性收紧方面,仍看不到转向的变化,总体股票市场可能会承压。股票仓位有必要保持谨慎,而在行业配置方面,对前期涨幅较大的家电、食品饮料等行业保持谨慎,而成长股或新兴产业行业跌幅较大,目前可以在这些行业寻找估值合理、增长确定的行业及个股。我们将在加强自上而下研究的前提下,自下而上精选个股,同时仍将采用把握波段的投资策略,重点将在新能源、非银金融、消费电子、医药、雄安概念等主题中寻找机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值1.288元,份额累计净值为1.758元,报告期内份额净值增长率为-6.67%,同期业绩比较基准收益率为4.84%。

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	182,114,561.49	75.59
	其中:股票	182,114,561.49	75.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,013,000.00	4.16
	其中:债券	10,013,000.00	4.16
	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	37,107,189.36	15.40
8	其他资产	11,688,310.65	4.85
9	合计	240,923,061.50	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	10,405,357.35	4.45
C	制造业	104,058,938.55	44.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,335,574.60	1.85
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	7,711,220.12	3.30
G	交通运输、仓储和邮政业	7,860,784.00	3.36
H	住宿和餐饮业	4,861,286.08	2.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,822,818.49	6.77
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,797,640.00	1.62
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	15,358,639.30	6.57
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	7,902,303.00	3.38
S	综合	-	-
	合计	182,114,561.49	77.86

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本报告期末未持有港股通股票。

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

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	002242	九阳股份	542,173	10,664,542.91	4.56
2	002831	裕同科技	128,619	9,646,425.00	4.12
3	002519	银河电子	1,199,440	9,439,592.80	4.04
4	002456	欧菲光	450,500	8,185,585.00	3.50
5	000050	深天马A	390,700	8,036,699.00	3.44
6	000026	飞亚达A	619,873	7,711,220.12	3.30
7	300050	世纪瑞利	750,889	7,561,452.23	3.23
8	002675	东诚药业	478,544	6,824,037.44	2.92
9	603338	浙江鼎力	99,296	6,546,585.28	2.80
10	603993	洛阳钼业	1,195,500	6,049,230.00	2.59

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	10,013,000.00	4.28
	其中:政策性金融债	10,013,000.00	4.28
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	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,013,000.00	4.28

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	140220	14国开20	100,000	10,013,000.00	4.28

注:本基金本报告期末仅持有上述债券。

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

注: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

注: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

注: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

注: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

注:本基金未参与投资股指期货。

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

注:本基金未参与投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注: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

注:本基金未参与投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	166,260.18
2	应收证券清算款	11,065,996.49
3	应收股利	-
4	应收利息	428,482.38
5	应收申购款	27,571.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,688,310.65

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注: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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002675	东诚药业	6,824,037.44	2.92	重大事项停牌

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	187,731,602.74
报告期期间基金总申购份额	5,560,453.67
减:报告期期间基金总赎回份额	11,637,886.21
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	181,654,170.20

§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

注:基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:基金管理人本报告期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

注:报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《信达澳银产业升级混合型证券投资基金基金合同》;

3、《信达澳银产业升级混合型证券投资基金托管协议》;

4、法律意见书;

5、基金管理人业务资格批件、营业执照;

6、基金托管人业务资格批件、营业执照;

7、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

融通中证军工指数分级证券投资基金

2017 第二季度 报告

2017年6月30日

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7月21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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年7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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通军工分级
场内简称	融通军工
交易代码	161628
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年7月1日
报告期末基金份额总额	317,360,972.73份
投资目标	本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪中证军工指数,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和建指数化投资组合,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%×中证军工价格指数收益率+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,融通军工A份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征;融通军工B份额具有高预期风险、预期收益相对较高的特征。
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

下属分级基金的基金简称	融通军工分级	军工股A	军工股B
下属分级基金场内简称	融通中证军工	军工股A	军工股B
下属分级基金的交易代码	161628	150335	150336
报告期末下属分级基金的份额总额	96,508,108.73份	110,426,432.00份	110,426,432.00份
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。	融通军工股A份额为稳健收益类份额,具有低预期风险、预期收益相对稳定的风险收益特征	融通军工股B份额为积极收益类份额,具有高预期风险、预期收益相对较高的风险收益特征。

§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4月1日 — 2017年6月30日)
1.本期已实现收益	-14,393,756.51
2.本期利润	-43,914,546.47
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1216
4.期末基金资产净值	218,456,107.97
5.期末基金份额净值	0.688

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。

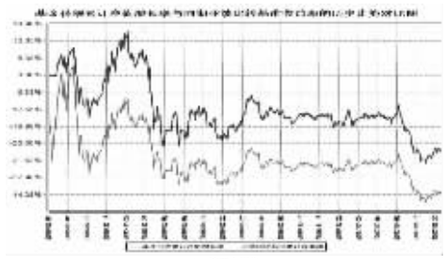
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-13.78%	1.44%	-15.31%	1.45%	1.53%	-0.01%

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



§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		
何天翔	本基金的基金经理	2015年7月1日	-	9	何天翔先生,厦门大学经济学硕士,安徽大学理学学士,9年证券投资从业经历,具有基金从业资格,曾就职于华泰联合证券有限公司任金融工程分析师,2010年3月加入融通基金管理有限公司,历任金融工程研究员、专户投资投资经理,现任融通深证100指数、融通军工分级、融通证券分级、融通中证大农业指数基金(LOF)(由原融通中证大农业指数分级证券投资基金转型而来)、融通新趋势灵活配置混合、融通创业板指数分级、融通通瑞债券、融通人工智能指数(LOF)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

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,通过控制股票权重与中证军工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军工指数的一个有效工具。

本报告期内,本基金日均跟踪偏离为0.07%,年化跟踪误差为1.41%,符合基金合同约定。

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0.688元;本报告期基金份额净值增长率为-13.78%,业绩比较基准收益率为-15.31%。

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	198,198,108.12	90.44
	其中:股票	198,198,108.12	90.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	20,647,914.43	9.42
8	其他资产	299,575.46	0.13
9	合计	219,141,598.01	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	182,677,721.97	83.62
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	1,863,215.92	0.85
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	7,004,767.22	3.21
J	金融业	-	-
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	1,526,410.44	0.70
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	193,072,115.55	88.38

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

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	采掘业	-	-
C	制造业	2,185,375.35	1.00
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	2,940,617.22	1.35
J	金融业	-	-
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	5,125,992.57	2.35

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

5.3.1 报告期末指数投资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	601989	中国重工	3,528,869	22,796,106.14	10.44
2	000768	中航飞机	513,051	9,460,660.44	4.33
3	600893	航发动力	307,789	8,402,639.70	3.85
4	002465	海格通信	636,059	6,831,273.66	3.13
5	600118	中国卫星	218,768	6,090,501.12	2.79
6	600150	中国船舶	255,487	5,842,987.69	2.67
7	002049	紫光国芯	180,101	5,550,712.82	2.54
8	600879	航天电子	608,150	5,343,638.50	2.45
9	002013	中航机电	466,969	4,823,789.77	2.21
10	002179	中航光电	146,365	4,565,124.35	2.09

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

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	300324	旋极信息	113,615	2,072,337.6	0.95
2	002253	川大智胜	35,860	860,640	0.39
3	600501	航天晨光	50,125	749,368.75	0.34
4	002519	银河电子	67,800	533,586	0.24
5	600523	贵航股份	28,722	531,644.22	0.24

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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持有股指期货。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内,基金投资的前十名证券中的发行主体中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、处罚的情况如下:

1、生物股份

2016年12月1日,金宇生物技术股份有限公司(以下简称"公司")收到中国证券监督管理委员会内蒙古监管局(以下简称"内蒙古证监局")《关于对金宇生物技术股份有限公司采取责令改正措施的决定》([2016]7号,以下简称"《决定书》")。针对公司会计估计变更未披露、公司财务报表列报不准确、内幕信息知情人登记执行不到位等问题,根据《上市公司信息披露管理办法》第五十九条及《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》第十五条的规定,我局决定对你公司采取责令改正的行政监管措施。

2、盐湖股份

中国证券监督管理委员会青海监管局(以下简称"青海证监局")于2016年10月24日至11月4日对公司募集资金、内部控制、固定资产核算及管理进行了专项现场检查。近日,公司收到了青海证监局《关于对青海盐湖工业股份有限公司采取责令改正措施的决定》(【2016】5号,以下简称"《决定书》"),公司因(1)公司部分募集资金存储不规范;(2)公司非公开发行股票存在未填写内幕信息知情人档案、未制作重大事项进程备忘录情况等行为违反了《上市公司证券发行管理办法》第三十八条第(三)款规定和《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》第十条规定。

本基金依照法律法规及基金合同的约定,采取指数化投资策略,紧密跟踪标的指数。

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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,534.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	186.09
5	应收申购款	48,209.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	48,122.86
8	其他	-
9	合计	99,053.26

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	93,263,621.87
报告期期间基金总申购份额	69,626,104.34
减:报告期期间基金总赎回份额	137,237,429.48
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	70,855,812.00
报告期末基金份额总额	96,508,108.73

序号	项目	融通军工分级	军工股A	军工股B
			145,854,338.00	145,854,338.00
			69,626,104.34	-
			137,237,429.48	-
			-35,427,906.00	-35,427,906.00
			110,426,432.00	110,426,432.00

注:拆分变动份额为本报告期发生的配对转换份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(一)《融通中证军工指数分级证券投资基金基金合同》

(二)《融通中证军工指数分级证券投资基金基金托管协议》

(三)《融通中证军工指数分级证券投资基金基金招募说明书》及其更新

(四)《融通中证军工指数分级证券投资基金之军工股A和军工股B上市交易公告书》

(五)《融通基金管理有限公司开放式基金业务管理规则》

(六)融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照

(七)报告期内在指定报刊上披露的各项公告

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7月21日

融通中证大农业指数证券投资基金(LOF)

2017 第二季度 报告

2017年6月30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
报告送出日期:2017年7月21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7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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年4月1日起至6月30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)
场内简称	融通农业
交易代码	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
报告期末基金份额总额	17,367,707.84份
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和建指数化投资组合,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,其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§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4月1日 — 2017年6月30日)
1.本期已实现收益	-1,078,331.75
2.本期利润	-15,863,637.19
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0554
4.期末基金资产净值	15,863,637.19
5.期末基金份额净值	0.913

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