

融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金

2013第四季度报告

2013年12月31日

基金管理人:融通基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月21日

\$1 重要提示

基金管理人的董事、监事及高级管理人员不存在虚假记载、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基金合同规定,于2014年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告,对本基金不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
基金管理人承诺在基金募集期间及募集结束后,持续监督基金的运作,勤勉尽责地履行基金托管人的职责,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。投资人投资于基金前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报登载的数据未经审计。

本基金自2013年10月1日起至2013年12月31日止。

\$2 基本产品概况

基金简称 融通标普中国可转债指数增强
交易代码 161624
基金运作方式 灵活型开放式
基金合同生效日 2013年3月26日
报告期末基金份额总额 171,683,898.28份

本基金为债券型指数基金,对指数投资部分,采用复制法的指数策略,按照样本券在指数中的权重构造指数化投资组合,并根据指数成份券的调整,定期或不定期地对投资组合进行调整,以期在一定程度上减小跟踪误差,从而在一定程度上降低投资组合的跟踪误差。

本基金的基金管理人和基金托管人承诺在基金募集期间及募集结束后,持续监督基金的运作,勤勉尽责地履行基金托管人的职责,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。投资人投资于基金前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报登载的数据未经审计。

本基金自2013年10月1日起至2013年12月31日止。

注:1)任日期指基金管理人对外披露的任职日期;2)证券从业年限以从事证券业务相关工作的年限为计算标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵守信守情况的说明

本基金报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金基金合同》的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益,不存在损害基金持有人利益的行为。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、交易和业绩评价等各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公平交易的制度和流程。

4.4 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。

4.5 报告期内基金的利润分配情况

本基金报告期内未发生利润分配。

4.6 报告期内基金资产的流动性情况

本基金报告期内未发生大额赎回。

4.7 报告期内基金的估值政策

本基金采用指数化估值方法。

4.8 报告期内基金的收益分配情况

本基金报告期内未进行收益分配。

4.9 报告期内基金的费用概览

本基金报告期内未发生费用。

4.10 报告期内基金的交易费用

本基金报告期内未发生交易费用。

4.11 报告期内基金的申购、赎回费用

本基金报告期内未发生申购、赎回费用。

4.12 报告期内基金的转换费用

本基金报告期内未发生转换费用。

4.13 报告期内基金的定期定额投资费用

本基金报告期内未发生定期定额投资费用。

4.14 报告期内发生的其他费用

本基金报告期内未发生其他费用。

4.15 其他费用

本基金报告期内未发生其他费用。

4.16 报告期内基金的交易费用

本基金报告期内未发生交易费用。

4.17 报告期内基金的申购、赎回费用

本基金报告期内未发生申购、赎回费用。

4.18 报告期内基金的转换费用

本基金报告期内未发生转换费用。

4.19 报告期内基金的定期定额投资费用

本基金报告期内未发生定期定额投资费用。

4.20 报告期内发生的其他费用

本基金报告期内未发生其他费用。

4.21 报告期内基金的交易费用

本基金报告期内未发生交易费用。

4.22 报告期内基金的申购、赎回费用

本基金报告期内未发生申购、赎回费用。

4.23 报告期内基金的转换费用

本基金报告期内未发生转换费用。

4.24 报告期内基金的定期定额投资费用

本基金报告期内未发生定期定额投资费用。

4.25 报告期内发生的其他费用

本基金报告期内未发生其他费用。

4.26 报告期内基金的交易费用

本基金报告期内未发生交易费用。

4.27 报告期内基金的申购、赎回费用

本基金报告期内未发生申购、赎回费用。

4.28 报告期内基金的转换费用

本基金报告期内未发生转换费用。

4.29 报告期内基金的定期定额投资费用

本基金报告期内未发生定期定额投资费用。

4.30 报告期内发生的其他费用

本基金报告期内未发生其他费用。

4.31 报告期内基金的交易费用

本基金报告期内未发生交易费用。

4.32 报告期内基金的申购、赎回费用

本基金报告期内未发生申购、赎回费用。

4.33 报告期内基金的转换费用

本基金报告期内未发生转换费用。

4.34 报告期内基金的定期定额投资费用

本基金报告期内未发生定期定额投资费用。

4.35 报告期内发生的其他费用

本基金报告期内未发生其他费用。

4.36 报告期内基金的交易费用

本基金报告期内未发生交易费用。

4.37 报告期内基金的申购、赎回费用

本基金报告期内未发生申购、赎回费用。

4.38 报告期内基金的转换费用

本基金报告期内未发生转换费用。

4.39 报告期内基金的定期定额投资费用

本基金报告期内未发生定期定额投资费用。

4.40 报告期内发生的其他费用

本基金报告期内未发生其他费用。

4.41 报告期内基金的交易费用

本基金报告期内未发生交易费用。

4.42 报告期内基金的申购、赎回费用

本基金报告期内未发生申购、赎回费用。

4.43 报告期内基金的转换费用

本基金报告期内未发生转换费用。

4.44 报告期内基金的定期定额投资费用

本基金报告期内未发生定期定额投资费用。

4.45 报告期内发生的其他费用

本基金报告期内未发生其他费用。

4.46 报告期内基金的交易费用

本基金报告期内未发生交易费用。

4.47 报告期内基金的申购、赎回费用

本基金报告期内未发生申购、赎回费用。

4.48 报告期内基金的转换费用

本基金报告期内未发生转换费用。

4.49 报告期内基金的定期定额投资费用

本基金报告期内未发生定期定额投资费用。

4.50 报告期内发生的其他费用

本基金报告期内未发生其他费用。

4.51 报告期内基金的交易费用

本基金报告期内未发生交易费用。

4.52 报告期内基金的申购、赎回费用

本基金报告期内未发生申购、赎回费用。

4.53 报告期内基金的转换费用

本基金报告期内未发生转换费用。

4.54 报告期内基金的定期定额投资费用

本基金报告期内未发生定期定额投资费用。

4.55 报告期内发生的其他费用

本基金报告期内未发生其他费用。

4.56 报告期内基金的交易费用

本基金报告期内未发生交易费用。

4.57 报告期内基金的申购、赎回费用

本基金报告期内未发生申购、赎回费用。

4.58 报告期内基金的转换费用

本基金报告期内未发生转换费用。

4.59 报告期内基金的定期定额投资费用

本基金报告期内未发生定期定额投资费用。

4.60 报告期内发生的其他费用

本基金报告期内未发生其他费用。

4.61 报告期内基金的交易费用

本基金报告期内未发生交易费用。

4.62 报告期内基金的申购、赎回费用

本基金报告期内未发生申购、赎回费用。

4.63 报告期内基金的转换费用

本基金报告期内未发生转换费用。

4.64 报告期内基金的定期定额投资费用

本基金报告期内未发生定期定额投资费用。

4.65 报告期内发生的其他费用

本基金报告期内未发生其他费用。

4.66 报告期内基金的交易费用

本基金报告期内未发生交易费用。

4.67 报告期内基金的申购、赎回费用

本基金报告期内未发生申购、赎回费用。

4.68 报告期内基金的转换费用

本基金报告期内未发生转换费用。

4.69 报告期内基金的定期定额投资费用

本基金报告期内未发生定期定额投资费用。

4.70 报告期内发生的其他费用

本基金报告期内未发生其他费用。

4.71 报告期内基金的交易费用

本基金报告期内未发生交易费用。

4.72 报告期内基金的申购、赎回费用

本基金报告期内未发生申购、赎回费用。

4.73 报告期内基金的转换费用

本基金报告期内未发生转换费用。

4.74 报告期内基金的定期定额投资费用

本基金报告期内未发生定期定额投资费用。

4.75 报告期内发生的其他费用

本基金报告期内未发生其他费用。

4.76 报告期内基金的交易费用

本基金报告期内未发生交易费用。

4.77 报告期内基金的申购、赎回费用

本基金报告期内未发生申购、赎回费用。

4.78 报告期内基金的转换费用

本基金报告期内未发生转换费用。

4.79 报告期内基金的定期定额投资费用

本基金报告期内未发生定期定额投资费用。

4.80 报告期内发生的其他费用

本基金报告期内未发生其他费用。

4.81 报告期内基金的交易费用

本基金报告期内未发生交易费用。

4.82 报告期内基金的申购、赎回费用

本基金报告期内未发生申购、赎回费用。

4.83 报告期内基金的转换费用

本基金报告期内未发生转换费用。

4.84 报告期内基金的定期定额投资费用

本基金报告期内未发生定期定额投资费用。

4.85 报告期内发生的其他费用

本基金报告期内未发生其他费用。

4.86 报告期内基金的交易费用