融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金

2018年第二季度报告

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:2018年7月19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2018年7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2018年4月1日起至2018年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通新机遇灵活配置混合
交易代码	002049
前端交易代码	002049
后端交易代码	002050
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年11月17日
报告期末基金份额总额	1,010,363,256.11份
投资目标	在严格控制风险的前提下,投资于优质上市公司,并结合积极的大类资产配置,谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	在经济周期各阶段,综合对所跟踪的宏观经济指标和市场指标的分析,本基金对大类资产进行配置的策略为:在经济的复苏和繁荣阶段由配股票资产;在经济的衰退和政策刺激阶段,超配债券等固定收益类资产;力争通过资产配置获得部分超额收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中债综合全价(总值)指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。
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(2018年4月1日 - 2018年6月30日)
1.本期已实现收益	10,628,179.77
2.本期利润	6,302,119.96
3.加权平均基金份额本期利润	0.0062
4.期末基金资产净值	1,042,241,588.92
5.期末基金份额净值	1.032

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。

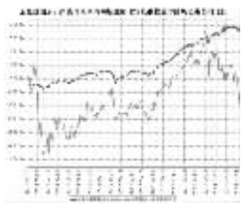
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	0.68%	0.17%	-4.52%	0.57%	5.20%	-0.40%

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



§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		
张一格	本基金的基金经理、固定收益投资总监	2016年9月22日	-	12	张一格先生,中国人民银行研究生部经济学硕士,南开大学法学学士,美国特许金融分析师(CFA),12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投资总监。历任兴业银行资金营运中心投资经理、国泰基金管理有限公司国泰民安增利债券等基金的基金经理。2015年6月加入融通基金管理有限公司,现任融通通盈保本、融通新机遇灵活配置混合、融通通裕债券、融通收益增强债券、融通通昊定期开放债券发起式基金的基金经理。
余志勇	本基金的基金经理、研究部总监	2015年11月17日	-	18	余志勇先生,武汉大学金融学硕士,工商管理学学士,18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研究部总监。历任湖北省农业厅财政处,国发证券公司研究员,招商证券股份有限公司研究发展中心研究员。2007年4月加入融通基金管理有限公司,历任研究部行业研究员,行业组长,现任融通通泰保本、融通通鑫灵活配置混合、融通新机遇灵活配置混合、融通增裕债券、融通四季添利债券(LOF)、融通通润债券、融通通顺定期开放债券、融通新动力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

本基金的投资目标是绝对收益,同时为了保持基金净值增长率的平稳性,本基金保持了较低的仓位,并采取了组合投资和新股申购的投资策略。

2018年以来资本市场对中国的增长前景判断分歧逐步加大:国家去杠杆带来的融资环境紧缩可能会逐步影响到实体经济;中美贸易摩擦的发展进程存在巨大的不确定性。另外信用债事件的不断出现也对资本市场的情绪打击明显。这些因素叠加导致二季度A股市场的走势大幅低于年初的市场预期。由于我们年初对以上主要事件相对谨慎,权益仓位一直保持在较低水平,资产配置也比较均衡,因此本基金取得了相对较好的效果。

展望下半年我们对股市不悲观,主要是A股市场整体估值已经处于历史较低的水平,中国经济的韧性也可能好于市场预期,中美贸易摩擦是一个长期博弈的过程,不排除短期出现缓和的机会。在投资策略上我们会继续采取相对均衡配置的阿尔法策略,力求在行业配置和个股选择上,获取持续稳定的超额收益α。同时力求根据市场的相应环境在仓位上作出更灵活的应对。

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1.032元;本报告期基金份额净值增长率为0.68%,业绩比较基准收益率为-4.52%。

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	131,433,178.20	10.10
	其中:股票	131,433,178.20	10.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,089,464,203.60	83.76
	其中:债券	1,089,464,203.60	83.76
	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	60,864,688.81	4.68
8	其他资产	18,998,730.78	1.46
9	合计	1,300,760,801.39	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	1,389,384.50	0.13
B	采矿业	4,118,673.00	0.40
C	制造业	82,725,722.48	7.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.01
E	建筑业	1,265,240.00	0.12
F	批发和零售业	6,558,052.00	0.63
G	交通运输、仓储和邮政业	1,527,941.00	0.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,306,236.00	0.70
J	金融业	6,627,916.52	0.64
K	房地产业	4,402,472.62	0.42
L	租赁和商务服务业	6,668,496.12	0.64
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,244,617.37	0.41
R	文化、体育和娱乐业	4,445,640.60	0.43
S	综合	-	-
	合计	131,433,178.20	12.61

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	103,532	6,668,496.12	0.64
2	300630	普利制药	86,500	6,279,900.00	0.60
3	600276	恒瑞医药	77,280	5,854,732.80	0.56
4	600801	华新水泥	288,700	4,339,161.00	0.42
5	300015	爱尔眼科	131,453	4,244,617.37	0.41
6	000338	潍柴动力	465,000	4,068,750.00	0.39
7	000568	泸州老窖	56,700	3,450,762.00	0.33
8	600031	三一重工	380,800	3,415,776.00	0.33
9	000333	美的集团	63,500	3,315,970.00	0.32
10	002410	广联达	93,600	2,595,528.00	0.25

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	248,290,000.00	23.82
	其中:政策性金融债	217,858,000.00	20.90
4	企业债券	223,335,676.60	21.43
5	企业短期融资券	20,038,000.00	1.92
6	中期票据	452,839,200.00	43.45
7	可转债(可交换债)	1,494,327.00	0.14
8	同业存单	143,467,000.00	13.77
9	其他	-	-
10	合计	1,089,464,203.60	104.53

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	101652003	16南电MTN001	800,000	79,616,000.00	7.64
2	180205	18国开05	600,000	62,922,000.00	6.04
3	136768	16苏海01	500,000	46,115,000.00	4.42
4	160415	16农发15	400,000	39,812,000.00	3.82
5	136177	16电气债	400,000	39,652,000.00	3.80

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

在法律法规允许的范围内,本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理,以套期保值为目的,对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险,提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。若法律法规或监管机构以后允许基金投资如期权、互换等其他金融衍生品种,本基金将以风险管理和组合优化为目的,根据届时法律法规的相关规定参与投资。

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

本基金本报告期末持有国债期货。

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

本基金本报告期末持有国债期货。

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。

5.11.2 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	12,374.81
2	应收证券清算款	87,452.50
3	应收股利	-
4	应收利息	18,898,903.47
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,998,730.78

5.11.4 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	132007	16凤凰EB	905,575.00	0.09

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	1,010,361,158.90
报告期期间基金总申购份额	21,026.20
减:报告期期间基金总赎回份额	18,928.99
报告期期末基金份额总额	1,010,363,256.11

§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	20180401-20180630	1,010,231,515.15	-	-	1,010,231,515.15	99.99%
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)中国证监会批准融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

(二)《融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

(三)《融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(四)《融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新

(五)融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照

(六)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

2018年7月19日

融通新能源灵活配置混合型证券投资基金

2018年第二季度报告

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:2018年7月19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2018年7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2018年4月1日起至2018年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通新能源灵活配置混合
交易代码	001471
前端交易代码	001471
后端交易代码	001472
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月29日
报告期末基金份额总额	1,264,707,164.89份
投资目标	通过梳理新能源产业发展所带来的投资机会,投资于相关优质上市公司,并结合积极的大类资产配置,谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金的资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究,基于定量与定性相结合的宏观及市场分析,确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例,规避系统性风险。本基金对大类资产进行配置的策略为:在经济的复苏和繁荣阶段由配股票资产;在经济的衰退和政策刺激阶段,超配债券等固定收益类资产,力争通过资产配置获得部分超额收益。
业绩比较基准	中证内地新能源主题指数收益率×50%+中债综合(全价)指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金,属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。
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(2018年4月1日 - 2018年6月30日)
1.本期已实现收益	-6,179,346.69
2.本期利润	-106,552,505.63
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1033
4.期末基金资产净值	1,336,452,750.47
5.期末基金份额净值	1.057

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。

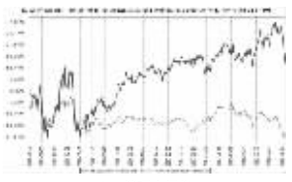
2. 本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-6.83%	1.28%	-10.21%	0.70%	3.38%	0.58%

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



§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		
付伟琦	本基金的基金经理、研究部总经理	2015/6/29	-	8	付伟琦先生,清华大学物理学博士、西安交通大学物理学学士,8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研究部总经理。历任中信证券公司行业研究员、瑞银证券公司行业研究员。2014年11月加入融通基金管理有限公司,现任融通新能源灵活配置混合、融通内需驱动混合、融通成长30灵活配置混合、融通新能源汽车主题精选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

本基金本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

本基金二季度的投资思路没有发生变化,依然以自下而上挖掘优质成长股为主,此外我们还重点买入了供给增量收缩,需求增长稳定的航空股。从宏观经济的角度看,5月以来出现边际弱化的迹象,因此我们在选股上避开了与宏观经济关联度高的板块和公司。

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1.057元;本报告期基金份额净值增长率为-6.83%,业绩比较基准收益率为-10.21%。

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	1,256,659,346.08	93.49
	其中:股票	1,256,659,346.08	93.49
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	86,275,681.19	6.42
8	其他资产	1,255,246.92	0.09
9	合计	1,344,190,274.19	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	569,959,329.50	42.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	131,485,831.00	9.84
G	交通运输、仓储和邮政业	361,895,903.22	27.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	54,906,724.37	4.11
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	81,226.14	0.01
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	138,258,772.00	10.35
S	综合	-	-
	合计	1,256,659,346.08	94.03

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	300144	宋城演艺	5,883,352	138,258,772.00	10.35
2	002640	跨境通	8,754,050	131,485,831.00	9.84
3	002832	比音勒芬	3,317,363	122,742,431.00	9.18
4	600115	东方航空	18,208,110	120,537,688.20	9.02
5	600029	南方航空	13,571,300	114,677,485.00	8.58
6	002745	木林森	6,416,638	114,151,990.02	8.54
7	601111	中国国航	11,105,341	98,726,481.49	7.39
8	002180	纳思达	3,507,436	96,314,192.56	7.21
9	603308	应流股份	7,133,653	92,309,469.82	6.91
10	300365	恒华科技	2,661,499	54,906,724.37	4.11

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

在法律法规允许的范围内,本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理,以套期保值为目的,对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险,提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

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

本基金本报告期末持有国债期货。

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

本基金本报告期末持有国债期货。

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。

5.11.2 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	573,872.13
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	18,990.97
5	应收申购款	662,383.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,255,246.92

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	875,142,528.98
报告期期间基金总申购份额	487,496,457.45
减:报告期期间基金总赎回份额	97,931,821.54
报告期期末基金份额总额	1,264,707,164.89

§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	-
报告期期间买入/申购总份额	4,303,445.45
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期末管理人持有的本基金份额	4,303,445.45
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.34

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	网上直销申购	2018-05-25	819,000.82	1,000,000.00	0
2	网上直销申购	2018-05-28	811,681.31	1,000,000.00	0
3	网上直销申购	2018-05-31	411,184.21	500,000.00	0
4	网上直销申购	2018-06-07	402,576.49	500,000.00	0
5	网上直销申购	2018-06-08	406,834.83	500,000.00	0
6	网上直销申购	2018-06-12	808,407.44	1,000,000.00	0
7	网上直销申购	2018-06-13	408,163.27	500,000.00	0
8	红利转投资	2018-06-27	235,590.08	244,071.32	0
合计			4,303,445.45	5,244,071.32	

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准融通新能源灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

(二)《融通新能源灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

(三)《融通新能源灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(四)《融通新能源灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新

(五)融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照

(六)报告期内在指定报刊上披露的各项公告

8.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

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

2018年7月19日

融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金

2018年第二季度报告

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:2018年7月19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2018年7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2018年4月1日起至2018年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通新区域新经济灵活配置混合
交易代码	001152
前端交易代码	001152
后端交易代码	001153
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月20日
报告期末基金份额总额	1,387,749,010.68份
投资目标	本基金按照"区域优势"和"战略性新兴产业"两条投资主线筛选符合条件的优质上市公司,分享中国区域经济增长和战略新兴产业发展中的投资机会,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的大类资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究,基于定量与定性相结合的宏观及市场分析,确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例,规避系统性风险。本基金对大类资产进行配置的策略为:在经济的复苏和繁荣阶段由配股票资产;在经济的衰退和政策刺激阶段,超配债券等固定收益类资产,力争通过资产配置获得部分超额收益。
业绩比较基准	中证新兴产业指数收益率×50%+中债综合(全价)指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中等风险水平的投资品种。
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(2018年4月1日 - 2018年6月30日)
1.本期已实现收益	-23,716,428.89
2.本期利润	-43,321,888.72
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0306
4.期末基金资产净值	683,738,781.76
5.期末基金份额净值	0.493

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。

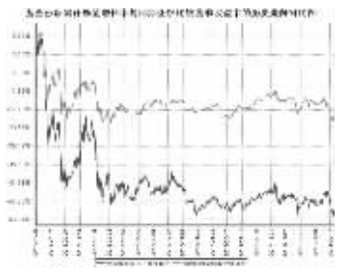
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-5.92%	1.44%	-6.17%	0.66%	0.25%	0.78%

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



§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		
彭炜	本基金的基金经理	2018年1月2日	-	6	彭炜先生,上海交通大学管理学硕士、工学学士,6年证券投资从业经历,具有基金从业资格。2012年4月加入融通基金,历任建筑建材、房地产、钢铁煤炭行业研究员,周期行业组长。现任融通中国风1号灵活配置混合、融通国企改革新机遇灵活配置混合、融通新区域新经济灵活配置混合基金的基金经理。
范晓	本基金的基金经理	2018年3月13日	-	6	范晓女士,复旦大学金融学硕士,湖南大学化学工程学士,6年证券投资从业经历,具有基金从业资格。2012年7月加入融通基金管理有限公司,历任化工行业研究员、周期组组长。现任融通中国风1号灵活配置混合、融通新区域新经济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