

信息披露 Disclosure

融通成长30灵活配置混合型证券投资基金

2018年第二季度报告

主,此外我们还重点买入供给增量收缩,需求增长稳定的航空股。从宏观经济角度看,6月以来出现以滞胀化的迹象,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1.055元;本报告期基金份额净值增长率为-6.22%,业绩比较基准收益率为-4.52%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明

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元的情形。

§ 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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	114,027,319.07	94.01
1.1	其中:股票	114,027,319.07	94.01
2	基金投资	-	-
2.1	固定收益投资	-	-
2.2	其中:债券	-	-
3	固定收益投资	-	-
3.1	其中:债券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
6.1	其中:买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,144,446.22	5.89
8	其他资产	119,676.49	0.10
9	合计	121,291,441.79	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	49,160,122.94	41.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,555.06	0.06
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	11,026,010.04	9.50
G	交通运输、仓储和邮政业	30,100,116.32	25.66
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,267,276.38	4.57
J	金融业	3,237,010.00	2.69
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	81,236.14	0.07
O	建筑业、房地产业和其他服务业	-	-
P	其他	-	-
Q	卫生和社公工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	12,063,090.00	10.00
S	综合	-	-
合计		114,027,319.07	94.01

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 管理人对于报告期内本基金运作遵守信情况的说明
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、交易和投资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理念,并将此原则贯彻于基金的运作之中。本基金运用指数化投资方式,采取量化跟踪进行指数增强和风险管理,在控制基金相对创业板指数基金基准的跟踪误差下,力求最终为投资者带来超越基金基准的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现
截至本报告期末融通创业板指数A/B基金份额净值为0.769元,本报告期基金份额净值增长率为-13.69%;截至本报告期末融通创业板指数C基金份额净值为0.768元;本报告期基金份额净值增长率为-13.61%;同期业绩比较基准收益率为-14.71%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明
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基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	796,769,227.95	99.81
1.1	其中:股票	796,769,227.95	99.81
2	基金投资	-	-
2.1	固定收益投资	30,062,410.00	3.89
2.2	其中:债券	30,062,410.00	3.89
3	固定收益投资	-	-
3.1	其中:债券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
4.1	其中:买入返售金融资产	-	-
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	36,133,297.57	4.52
8	其他资产	3,126,810.06	0.39
9	合计	814,090,756.11	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	59,671,666.68	7.61
B	采矿业	-	-
C	制造业	348,619,617.72	44.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,760,969.06	0.87
F	批发和零售业	30,062,410.00	3.89
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	197,006,101.26	25.13
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,263,526.00	0.67
M	科学研究和技术服务业	3,446,326.00	0.44
N	水利、环境和公共设施管理业	1,511,189.69	0.19
O	建筑业、房地产业和其他服务业	-	-
P	其他	-	-
Q	卫生和社公工作	37,351,196.81	4.83
R	文化、体育和娱乐业	34,130,191.16	4.36
S	综合	-	-
合计		721,090,662.61	91.93

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	59,671,666.68	7.61
B	采矿业	-	-
C	制造业	348,619,617.72	44.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,760,969.06	0.87
F	批发和零售业	30,062,410.00	3.89
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	197,006,101.26	25.13
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,263,526.00	0.67
M	科学研究和技术服务业	3,446,326.00	0.44
N	水利、环境和公共设施管理业	1,511,189.69	0.19
O	建筑业、房地产业和其他服务业	-	-
P	其他	-	-
Q	卫生和社公工作	37,351,196.81	4.83
R	文化、体育和娱乐业	34,130,191.16	4.36
S	综合	-	-
合计		721,090,662.61	91.93

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	59,671,666.68	7.61
B	采矿业	-	-
C	制造业	348,619,617.72	44.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,760,969.06	0.87
F	批发和零售业	30,062,410.00	3.89
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	197,006,101.26	25.13
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,263,526.00	0.67
M	科学研究和技术服务业	3,446,326.00	0.44
N	水利、环境和公共设施管理业	1,511,189.69	0.19
O	建筑业、房地产业和其他服务业	-	-
P	其他	-	-
Q	卫生和社公工作	37,351,196.81	4.83
R	文化、体育和娱乐业	34,130,191.16	4.36
S	综合	-	-
合计		721,090,662.61	91.93

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	59,671,666.68	7.61
B	采矿业	-	-
C	制造业	348,619,617.72	44.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,760,969.06	0.87
F	批发和零售业	30,062,410.00	3.89
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	197,006,101.26	25.13
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,263,526.00	0.67
M	科学研究和技术服务业	3,446,326.00	0.44
N	水利、环境和公共设施管理业	1,511,189.69	0.19
O	建筑业、房地产业和其他服务业	-	-
P	其他	-	-
Q	卫生和社公工作	37,351,196.81	4.83
R	文化、体育和娱乐业	34,130,191.16	4.36
S	综合	-	-
合计		721,090,662.61	91.93

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	59,671,666.68	7.61
B	采矿业	-	-
C	制造业	348,619,617.72	44.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,760,969.06	0.87
F	批发和零售业	30,062,410.00	3.89
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	197,006,101.26	25.13
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,263,526.00	0.67
M	科学研究和技术服务业	3,446,326.00	0.44
N	水利、环境和公共设施管理业	1,511,189.69	0.19
O	建筑业、房地产业和其他服务业	-	-
P	其他	-	-
Q	卫生和社公工作	37,351,196.81	4.83
R	文化、体育和娱乐业	34,130,191.16	4.36
S	综合	-	-
合计		721,090,662.61	91.93

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	114,027,319.07	94.01
1.1	其中:股票	114,027,319.07	94.01
2	基金投资	-	-
2.1	固定收益投资	-	-
2.2	其中:债券	-	-
3	固定收益投资	-	-
3.1	其中:债券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
6.1	其中:买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,144,446.22	5.89
8	其他资产	119,676.49	0.10
9	合计	121,291,441.79	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	49,160,122.94	41.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,555.06	0.06
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	11,026,010.04	9.50
G	交通运输、仓储和邮政业	30,100,116.32	25.66
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,267,276.38	4.57
J	金融业	3,237,010.00	2.69
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	81,236.14	0.07
O	建筑业、房地产业和其他服务业	-	-
P	其他	-	-
Q	卫生和社公工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	12,063,090.00	10.00
S	综合	-	-
合计		114,027,319.07	94.01

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	59,671,666.68	7.61
B	采矿业	-	-
C	制造业	348,619,617.72	44.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,760,969.06	0.87
F	批发和零售业	30,062,410.00	3.89
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	197,006,101.26	25.13
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,263,526.00	0.67
M	科学研究和技术服务业	3,446,326.00	0.44
N	水利、环境和公共设施管理业	1,511,189.69	0.19
O	建筑业、房地产业和其他服务业	-	-
P	其他	-	-
Q	卫生和社公工作	37,351,196.81	4.83
R	文化、体育和娱乐业	34,130,191.16	4.36
S	综合	-	-
合计		721,090,662.61	91.93

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	59,671,666.68	7.61
B	采矿业	-	-
C	制造业	348,619,617.72	44.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,760,969.06	0.87
F	批发和零售业	30,062,410.00	3.89
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	197,006,101.26	25.13
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,263,526.00	0.67
M	科学研究和技术服务业	3,446,326.00	0.44
N	水利、环境和公共设施管理业	1,511,189.69	0.19
O	建筑业、房地产业和其他服务业	-	-
P	其他	-	-
Q	卫生和社公工作	37,351,196.81	4.83
R	文化、体育和娱乐业	34,130,191.16	4.36
S	综合	-	-
合计		721,090,662.61	91.93

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	59,671,666.68	7.61
B	采矿业	-	-
C	制造业	348,619,617.72	44.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,760,969.06	0.87
F	批发和零售业	30,062,410.00	3.89
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	197,006,101.26	25.13
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,263,526.00	0.67
M	科学研究和技术服务业	3,446,326.00	0.44
N	水利、环境和公共设施管理业	1,511,189.69	0.19
O	建筑业、房地产业和其他服务业	-	-
P	其他	-	-
Q	卫生和社公工作	37,351,196.81	4.83
R	文化、体育和娱乐业	34,130,191.16	4.36
S	综合	-	-
合计		721,090,662.61	91.93

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(%)
----	------	---------	--------------