融通现金宝货币市场基金

2018年第三季度报告

基金管理人:融通基金管理有限公司
基金托管人:包商银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月24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。

基金托管人包商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月22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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通现金宝货币	
交易代码	002788	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年11月10日	
报告期末基金份额总额	2,183,126,329.59份	
投资目标	在严格控制基金资产投资风险和保持基金资产较高流动性的基础上,力争获得超越业绩比较基准的稳定回报。	
投资策略	根据对未来短期利率变动的预测,确定和调整基金投资组合的平均剩余期限。对各类投资品种进行定性分析和定量分析,确定和调整参与的投资品种和各类投资品种的配置比例。在严格控制投资风险和保持资产流动性的基础上,力争获得稳定的当期收益。	
业绩比较基准	银行活期存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种,其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
基金托管人	包商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	融通现金宝货币A	融通现金宝货币B
下属分级基金的交易代码	002788	004398
报告期末下属分级基金的份额总额	400,420,374.83份	1,782,705,954.76份

§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7月1日 - 2018年9月30日)	
	融通现金宝货币A	融通现金宝货币B
1. 本期已实现收益	4,055,500.08	19,468,842.22
2. 本期利润	4,055,500.08	19,468,842.22
3. 期末基金资产净值	400,420,374.83	1,782,705,954.76

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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

(2)本基金自基金合同生效日起,利润分配是"每日分配收益,按日结转份额"。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

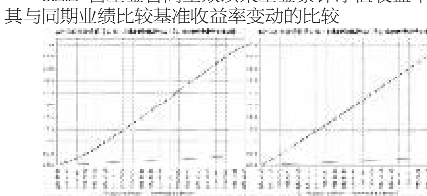
融通现金宝货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.8786%	0.0015%	0.0882%	0.0000%	0.7904%	0.0015%

融通现金宝货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.9398%	0.0015%	0.0882%	0.0000%	0.8516%	0.0015%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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		
王超	本基金的基金经理、固定收益部总监。	2016年11月10日	-	11	王超先生,金融工程硕士,经济学、数学双学士,11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总监。历任深圳发展银行(现更名为平安银行)债券自营交易盘投资与理财投资管理经理。2012年8月加入融通基金管理有限公司,现任融通债券、融通四季添利债券(LOF)、融通岁岁添利定期开放债券、融通增鑫债券、融通增益债券、融通通泰保本混合、融通现金宝货币、融通稳利债券、融通汇财宝货币、融通易支付货币基金的基金经理。

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

货币政策基调表述从"合理稳定"转为"合理充裕",并且央行于7月份再次实施了定向降准,三季度资金较二季度大幅宽松。银行间7天回购利率中枢由二季度3.40%下降至2.68%,交易所7天回购利率中枢从4.13%下降到2.77%;3个月存单及存款利率大幅下行,由二季度末的4.3%降至三季度的2.85%附近

投资方面,本基金在三季度适度提升了组合剩余期限。

展望四季度,社融年初以来持续的回落将在未来的经济数据上继续更为明显地体现,基建投资存在资金来源和投资意愿的约束,托底空间有限;贸易战对于外贸增长的负面影响会在"抢跑扰动"后加速显现。预计央行货币政策基调将与三季度一致,银行间市场货币资金有望维持宽松。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期融通现金宝货币A的基金份额净值收益率为0.8786%,本报告期融通现金宝货币B的基金份额净值收益率为0.9398%,同期业绩比较基准收益率为0.0882%。

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	固定收益投资	930,250,562.05	38.43
	其中:债券	890,250,562.05	36.78
	资产支持证券	40,000,000.00	1.65
2	买入返售金融资产	549,192,223.79	22.69
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	931,119,171.51	38.46
4	其他资产	10,223,229.50	0.42
5	合计	2,420,785,186.85	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额		14.16
	其中:买断式回购融资		-
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	236,039,245.94	10.81
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	74
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	86
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	56

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未出现超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	43.52	10.81
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
2	30天(含)-60天	21.50	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
3	60天(含)-90天	0.91	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
4	90天(含)-120天	29.15	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
5	120天(含)-397天(含)	15.34	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
	合计	110.42	10.81

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

报告期内投资组合平均剩余存续期限未出现超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	99,842,995.33	4.57
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,071,759.67	2.29
	其中:政策性金融债	50,071,759.67	2.29
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	740,335,807.05	33.91
8	其他		
9	合计	890,250,562.05	40.78
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111821144	18渤海银行CD144	1,000,000	98,681,447.46	4.52
2	111895606	18广州农村商业银行CD014	1,000,000	98,681,447.46	4.52
3	111819315	18恒丰银行CD315	800,000	79,008,003.68	3.62
4	111821143	18渤海银行CD143	800,000	78,070,424.13	3.58
5	111810052	18兴业银行CD052	700,000	69,793,397.72	3.20
6	189935	18贴现国债35	600,000	59,895,989.10	2.74
7	111811236	18平安银行CD236	500,000	49,783,478.25	2.28
8	111821276	18渤海银行CD276	500,000	49,772,727.91	2.28
9	111883835	18盛京银行CD374	500,000	49,252,355.79	2.26
10	111813050	18浙商银行CD050	500,000	48,813,537.45	2.24

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1796%
报告期内偏离度的最低值	0.0743%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1241%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期未出现偏离度绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期未出现偏离度绝对值达到0.50%的情况。

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十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	139089	万科24A1	200,000.00	20,000,000.00	0.92
2	139059	万科22A1	100,000.00	10,000,000.00	0.46
3	149794	金地02A	100,000.00	10,000,000.00	0.46

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价和折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

5.9.2 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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,713.75
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	8,822,135.11
4	应收申购款	1,396,380.64
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	10,223,229.50

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	融通现金宝货币A	融通现金宝货币B
报告期期初基金份额总额	530,185,156.60	2,297,570,763.15
报告期期间基金总申购份额	85,491,220.01	1,251,058,601.77
报告期期间基金总赎回份额	215,256,001.78	1,765,923,410.16
报告期期末基金份额总额	400,420,374.83	1,782,705,954.76

§7 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年9月21日	1,000,000.00	1,000,000.00	-
2	红利转投资	2018年9月28日	367.45	367.45	-
合计			1,000,367.45	1,000,367.45	

§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现金宝货币市场基金设立的文件

(二)《融通现金宝货币市场基金基金合同》

(三)《融通现金宝货币市场基金托管协议》

(四)《融通现金宝货币市场基金招募说明书》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、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10月24日

融通新消费灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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10月24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10月22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7月1日起至2018年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通新消费灵活配置混合
交易代码	002605
前端交易代码	002605
后端交易代码	002606
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年5月27日
报告期末基金份额总额	72,529,315.67份
投资目标	本基金主要投资于新消费主题相关优质上市公司,同时通过合理的动态资产配置,在注重风险控制的原则下,追求超越基金业绩比较基准的长期稳定资本增值。
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,力争获得部分超额收益。
业绩比较基准	中证全指主要消费指数收益率×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7月1日 - 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-6,075,885.40
2.本期利润	-5,580,486.39
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0778
4.期末基金资产净值	87,055,408.42
5.期末基金份额净值	1.200

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。

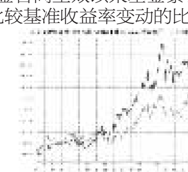
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-6.10%	0.95%	-2.50%	0.75%	-3.60%	0.20%

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		
关山	本基金的基金经理、研究部副总监	2016年6月3日	-	12	关山女士,英国帝国理工大学金融学硕士、英国伯明翰大学经济学学士,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研究部副总监。2006年3月加入融通基金,历任纺织服装、餐饮旅游行业研究员、轻工制造行业研究员、消费组组长。现任融通新消费灵活配置混合、融通跨界成长灵活配置混合、融通红利机会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

2018年2季度整个市场出现较多的信息扰动,国内因为去杠杆等监管政策的出台,M2,社融,基建投资等数据明显走弱;海外受贸易战持续升级,美联储加息美元升值等影响,市场整体走势波幅较大。进入2季度,A股市场避险情绪明显增强。整个3季度,市场延续2季度风险偏好较低的态势,市场始终处于底部区间震荡,成交量低迷。站在当前时点,我们已经从数据看到经济走弱的迹象,市场分歧主要集中在政策的底线思维,经济是否放缓幅度较小,后续能够稳住,及贸易战后续的演绎。

市场风险因素在先前两个季度有所释放,但是我们所面临的贸易战,经济增速下滑,企业盈利下降等大背景并未发生改变,我们在组合配置上持谨慎态度,对仓位进行一定的控制。3季报即将进入披露期,我们下一步的工作是对即将出炉的报表进行甄别,希望能从中找到更多稳健并且符合产业发展趋势的标的。

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1.200元;本报告期基金份额净值增长率为-6.10%,业绩比较基准收益率为-2.50%。

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	47,094,538.68	51.77
	其中:股票	47,094,538.68	51.77
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	43,614,990.35	47.95
8	其他资产	253,153.03	0.28
9	合计	90,962,682.06	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	2,547,395.00	2.93
B	采矿业	3,972,468.72	4.56
C	制造业	18,839,630.00	21.64
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	1,590,680.00	1.83
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,665,683.91	7.66
J	金融业	3,702,909.00	4.25
K	房地产业	2,706,606.00	3.11
L	租赁和商务服务业	4,029,816.05	4.63
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	3,039,350.00	3.49
S	综合	-	-
	合计	47,094,538.68	54.10

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	600028	中国石化	557,931	3,972,468.72	4.56
2	300630	普利制药	51,900	3,257,763.00	3.74
3	300144	宋城演艺	136,600	3,039,350.00	3.49
4	300146	汤臣倍健	133,900	2,744,950.00	3.15
5	600271	航天信息	93,000	2,588,190.00	2.97
6	603868	飞科电器	49,400	2,477,410.00	2.85
7	002032	苏泊尔	43,500	2,348,130.00	2.70
8	601888	中国国旅	34,025	2,314,380.50	2.66
9	601336	新华保险	38,700	1,953,576.00	2.24
10	000860	顺鑫农业	41,900	1,910,640.00	2.19

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。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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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	66,405.10
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,665.29
5	应收申购款	178,082.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	253,153.03

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	71,872,428.17
报告期期间基金总申购份额	2,553,397.40
减:报告期期间基金总赎回份额	1,896,509.90
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	72,529,315.67

§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 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消费灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

(二)《融通新消费灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

(三)《融通新消费灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(四)《融通新消费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、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10月24日

融通中国风1号灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:融通基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月24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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月22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7月1日起至2018年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通中国风1号灵活配置混合
交易代码	001852
前端交易代码	001852
后端交易代码	001853
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年2月3日
报告期末基金份额总额	38,594,528.96份
投资目标	本基金精选优质上市公司进行投资,分享相关行业、上市公司发展过程中的投资机会,在保证本金安全的前提下,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。
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

主要财务指标	报告期(2018年7月1日 - 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-1,174,099.54
2.本期利润	-1,234,457.21
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0356
4.期末基金资产净值	43,627,319.29
5.期末基金份额净值	1.130

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。

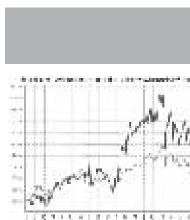
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-2.84%	1.55%	-0.60%	0.67%	-2.24%	0.88%

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		
范琨	本基金的基金经理	2016年2月5日	-	6	范琨女士,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。
彭炜	本基金的基金经理	2017年8月5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。

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

国内宏观经济在面临内部去杠杆、外部贸易摩擦不断的大背景下,总需求虽面临一定程度的放缓,但结构上地产投资和制造业投资上则体现出了较强的经济韧性;同时年内连续降准,叠加积极财政政策信号的释放,在一定程度上亦是对冲外部贸易摩擦不确定性的举措。因此,可以预期未来一段时间,整体宏观经济是有望趋平稳态势的。另外,通过跟踪研究部分各细分行业的中微观数据,同样可以发现一些受益供给侧改革的传统周期品、受益政策驱动或基本面改善的部分医药子行业、受益大众品牌消费升级的消费品,以及TMT中的云计算、5G等领域,持续维持着不断改善的产业景气趋势,因此这部分是本报告期内持续重点关注和投资的领域,本基金则相应地在医药、大众食品和云计算等相关细分板块做了重点配置,同时在周期品方面结合市场对宏观预期的变化进行了一定的阶段性波段操作等。目前从整体结构来看,本基金继续维持淡化风格,景气为矛,并考虑整体市场当前估值处于历史偏低水平,故在仓位上亦继续维持偏中高仓位的积极状态。

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1.130元;本报告期基金份额净值增长率为-2.84%,业绩比较基准收益率为-0.60%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

从2018年6月15日至2018年9月6日,本基金存在连续二十个工作日以上基金资产净值低于五千万的情形。

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§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	32,842,634.46	72.81
	其中:股票	32,842,634.46	72.81
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	11,959,304.90	26.51
8	其他资产	305,186.31	0.68
9	合计	45,107,125.67	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	772,620.00	1.77
B	采矿业	-	-
C	制造业	25,909,946.46	59.39
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	1,045,856.00	2.40
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	1,523,782.00	3.49
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,503,136.00	5.74
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	1,087,294.00	2.49
S	综合	-	-
	合计	32,842,634.46	75.28

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	300630	普利制药	51,536	3,234,914.72	7.41
2	601888	中国国旅	36,800	2,503,136.00	5.74
3	000661	长春高新	8,200	1,943,400.00	4.45
4	600801	华新水泥	91,328	1,839,345.92	4.22
5	002798	帝欧家居	105,740	1,771,145.00	4.06
6	600271	航天信息	60,700	1,689,281.00	3.87
7	300604	长川科技	39,400	1,548,814.00	3.55
8	601100	恒立液压	68,960	1,539,876.80	3.53
9	002410	广联达	56,900	1,523,782.00	3.49
10	600585	海螺水泥	39,300	1,445,847.00	3.31

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

本基金以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货投资。本基金将根据对现货和期货市场的分析,发挥股指期货杠杆效应和流动性好的特点,采用股指期货在短期内取代部分现货,获取市场敞口,投资策略包括多头套期保值和空头套期保值。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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	28,264.61
2	应收证券清算款	273,640.76
3	应收股利	-
4	应收利息	2,380.14
5	应收申购款	900.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	305,186.31

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	32,736,097.04
报告期期间基金总申购份额	12,569,256.44
减:报告期期间基金总赎回份额	6,710,824.52
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	38,594,528.96

§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	7,929,605.48
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	7,929,605.48
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	20.55

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况无变化。

§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	2018-07-01~2018-09-07,2018-09-20~2018-09-30	7,929,605.48	0.00	0.00	7,929,605.48	20.55%
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)《融通中国风1号灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

(二)《融通中国风1号灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(三)《融通中国风1号灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新

(四)中国证监会批准融通中国风1号灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

(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10月24日