

# 信息披露

## 融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)

### 2019年第一季度报告



注：本基金于2017年7月6日增投C类份额，本基金A类份额的统计区间为2017年7月6日至本报告期末。

#### 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时间	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
葛志伟	本基金的基金经理	2019-02-1	-	-	8	葛志伟先生，中国政法大学法律硕士，广东大学计算机学士，金融风险管理师（FRM），并持有基金从业资格，具有基金从业资格。曾担任广发证券股份有限公司资产管理部基金经理，2014年6月加入融通基金管理有限公司，历任权益投资部基金经理、金融工研部主管、权益投资部副经理、权益投资部副经理兼权益投资部副经理，自2018年10月1日起担任融通巨潮100指数证券投资基金基金经理，融通巨潮100指数证券投资基金基金经理。

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 管理人报告期内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，为基金份额持有人谋求最大利益。无损害基金份额持有人利益的行为，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 报告期内基金的投资策略和运作分析  
截至本报告期末融通巨潮100指数A/B基金份额净值为1.207元，本报告基金份额净值增长率为26.96%；截至本报告期末融通巨潮100指数C基金份额净值为1.076元，本报告基金份额净值增长率为26.74%；同期业绩比较基准收益率为26.27%。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通巨潮100指数A/B基金份额净值为1.207元，本报告基金份额净值增长率为26.96%；截至本报告期末融通巨潮100指数C基金份额净值为1.076元，本报告基金份额净值增长率为26.74%；同期业绩比较基准收益率为26.27%。

#### 4.6 报告期内基金持有人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人数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	724,868,116.00	94.72
2	基金投资	724,868,116.00	94.72
3	其中：股票	22,603,799.06	2.91
4	其中：债券	22,603,799.06	2.91
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其中：买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	19,980,688.96	2.59
9	其他资产	2,343,090.88	0.30
10	合计	776,796,899.18	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	26,600,347.89	2.32
B	采矿业	18,419,899.58	1.63
C	制造业	248,662,030.82	21.85
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	387,290.00	0.03
E	建筑业	23,827,100.79	2.10
F	批发和零售业	2,807,400.00	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	12,161,165.12	1.06
H	信息技术业	18,897,960.89	1.66
I	金融业	316,060,277.63	27.83
J	房地产业	21,726,109.00	1.91
K	租赁和商务服务业	6,666,222.62	0.58
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	卫生和社公工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	680,996,190.74	59.90
合计		680,996,190.74	59.90

##### 5.2.2 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	2,224,043.00	0.20
B	采矿业	-	-
C	制造业	16,418,039.63	1.43
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,366,760.00	0.21
H	信息技术业	8,601,311.84	0.75
I	金融业	11,184,079.00	0.97
J	房地产业	1,631,500.00	0.14
K	租赁和商务服务业	-	-
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	居民服务、修理和其他服务业	-	-
O	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	1,822,600.00	0.16
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		44,780,010.17	3.90

## 融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)

### 2019年第一季度报告



注：本基金业绩比较基准项目分段计算，其中2015年9月30日之前（含当日）采用“沪深300指数收益率×80%+中信标普全债指数收益率×20%”，2015年10月1日起使用新基准即“沪深300指数收益率×80%+中债综合全价（总值）指数收益率×20%”。

#### 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时间	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
葛志伟	本基金的基金经理、权益投资部副经理	2017/12/18	-	-	10	葛志伟先生，中国人民大学法律硕士，北京大学法学学士，金融学硕士，曾任融通基金管理有限公司权益投资部副经理，现任融通基金管理有限公司权益投资部副经理，兼任权益投资部副经理，负责权益类基金的投资管理工作。2018年12月加入融通基金管理有限公司，担任权益投资部副经理，负责权益类基金的投资管理工作。2019年1月1日起担任融通领先成长混合型证券投资基金基金经理，融通领先成长混合型证券投资基金基金经理。
阿亮	本基金的基金经理	2019/03/23	-	-	7	阿亮先生，武汉大学金融学硕士，中国人民大学金融学硕士，7年证券从业经验，具有基金从业资格。2012年加入融通基金管理有限公司，历任权益投资部副经理、权益投资部副经理、权益投资部副经理，2019年3月23日起担任融通领先成长混合型证券投资基金基金经理，融通领先成长混合型证券投资基金基金经理。

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 管理人报告期内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，为基金份额持有人谋求最大利益。无损害基金份额持有人利益的行为，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

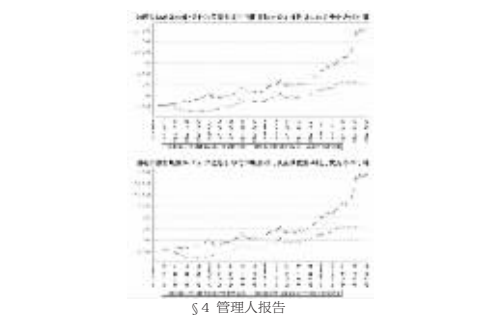
4.3.1 公平交易制度的执行情况  
本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则，并制定了相应的制度和流程，在授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

#### 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 报告期内基金的投资策略和运作分析  
2019年一季度市场整体大幅上涨，有2018年超跌后反弹的因素，也有上市公司商誉减值风险落地的因素，但更多还是宏观和政策层面有利的边际变化，包括社融的大超预期，以及科创板加速度推进都刺激了市场情绪进入阶段高点，并持续酝酿。更重要的是中美贸易谈判进入实质性阶段，2018年的不确定性阶段烟消云散。在

## 融通收益增强债券型证券投资基金

### 2019年第一季度报告



注：本基金业绩比较基准项目分段计算，其中2015年9月30日之前（含当日）采用“沪深300指数收益率×80%+中信标普全债指数收益率×20%”，2015年10月1日起使用新基准即“沪深300指数收益率×80%+中债综合全价（总值）指数收益率×20%”。

#### 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时间	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
张一伟	本基金的基金经理、固定收益部副经理	2019/01/30	-	-	13	张一伟先生，中国人民大学法律硕士，南开大学法学学士，南开大学金融学硕士，曾任融通基金管理有限公司固定收益部副经理，现任融通基金管理有限公司固定收益部副经理，负责固定收益类基金的投资管理工作。2019年1月30日加入融通基金管理有限公司，担任固定收益部副经理，负责固定收益类基金的投资管理工作。2019年1月30日起担任融通收益增强债券型证券投资基金基金经理，融通收益增强债券型证券投资基金基金经理。

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 管理人报告期内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，为基金份额持有人谋求最大利益。无损害基金份额持有人利益的行为，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 报告期内基金的投资策略和运作分析  
债券市场方面，2019年一季度，收益率先下后上，季末接近年初，除国债收益率有所下行外，其他期限收益率变化不大。在经历了18年的上座后，债市收益率处于历史低位水平，进一步的下行需要更强的催化。但一季度缺乏这样的行情，在整体估值已都修复的情况下，数据的边际变化更为重要。如果一季度经济数据能够显示经济企稳的迹象，市场的预期可能会进一步强化。在风险偏好回升的环境下，可以对中长期基本面较好的行业和个股保持密切关注。

#### 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	601318	中国平安	966,234	73,726,641.40	4.64
2	600036	招商银行	1,042,401	8,134,038.00	0.50
3	600655	贵州茅台	35,747	33,943,540.63	4.39
4	601398	工商银行	1,222,835	23,127,330.27	2.59
5	600868	招商局港口	566,771	22,460,527.91	2.62
6	601929	中国铁建	853,800	22,136,822.00	2.56
7	000061	格力电器	425,000	20,597,240.79	2.60
8	600270	恒顺达	278,478	18,007,040.92	2.24
9	601288	农业银行	4,760,000	17,720,980.84	2.29
10	000050	五粮液	185,024	17,603,200.00	2.23

#### 5.3.2 报告期末非指数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	000243	中航重机	280,300	8,134,038.00	1.06
2	000079	盐湖股份	719,500	4,800,280.00	0.62
3	601128	常铝股份	404,000	3,486,560.00	0.44
4	600486	横河电机	105,700	3,330,677.00	0.43
5	600670	恒电电子	30,485	2,469,360.00	0.36

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

1	国债000001	5,015,000.00	0.65
2	央行票据	-	-
3	金融债	17,004,300.00	2.20
3	其中:政策性金融债	17,004,300.00	2.20
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	564,495.05	0.07
8	资产支持证券	-	-
9	其他	-	-
10	合计	22,603,795.05	2.93

#### 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贵金属投资明细

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019049	190499	100,000	10,017,000.00	1.30
2	019049	190499	50,000	5,010,000.00	0.65
3	019049	190499	50,000	5,010,000.00	0.65
4	019049	190499	20,000	2,004,000.00	0.26
5	019049	190499	4,000	403,000.00	0.05

#### 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  
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  
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。

#### 5.11 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

5.11.1 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	600031	三一重工	177,749,497	227,362,040.46	16.85
2	601888	中国铝业	3,110,116	217,566,880.00	16.07
3	000001	长春高新	527,767	167,263,493.43	12.44
4	300630	普利制药	2,163,188	161,698,056.34	5.08
5	000038	潍柴动力	12,919,460	152,588,832.60	11.31
6	600095	华彬集团	4,124,281	94,674,176.00	7.05
7	600180	华鲁恒升	2,566,297	82,500,477.28	6.12
8	002476	立讯精密	3,568,598	79,585,068.00	5.97
9	600688	南玻集团	1,076,776	75,426,127.69	5.77
10	002167	正邦科技	4,317,788	70,336,760.82	5.12

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

1	国家债券		--	--
2	央行票据		--	--
3	金融债券		--	--
	其中：政策性金融债		--	--
4	企业债券		--	--
5	企业短期融资券		--	--
6	中期票据		--	--
7	可转换债（可交换债）	1,114,290.53	--	0.03
8	资产支持证券		--	--
9	其他		--	--
10	合计	1,114,290.53	--	0.03

#### 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贵金属投资明细

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	120001	120001	11,143	1,114,280.22	0.02

#### 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  
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  
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。

#### 5.11 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

5.11.1 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

# 资基金

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	
--------------------------------------	--