融通健康产业灵活配置混合型证券投资基金

2019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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月16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2019年7月12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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通健康产业灵活配置混合
基金主代码	000727
前端交易代码	000727
后端交易代码	000731
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年12月25日
报告期末基金份额总额	100,491,635.90份
投资目标	通过主要投资于健康产业的优质上市公司,同时通过合理的动态资产配置,在合理控制投资风险的基础上,获取基金资产的长期增值,力争实现超越业绩比较基准的长期收益。
投资策略	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	申万医药生物行业指数收益率×70%+中债综合(全价)指数收益率×30%。
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,属于中高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(2019年4月1日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	10,097,064.08
2.本期利润	8,538,972.42
3.加权平均基金份额本期利润	0.0848
4.期末基金资产净值	130,882,656.94
5.期末基金份额净值	1.302

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

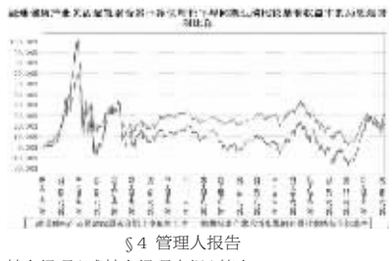
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	7.34%	1.55%	-5.33%	1.15%	12.67%	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	7.34%	1.55%	-5.33%	1.15%	12.67%	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		
万民远	本基金的基金经理	2016-08-26	-	8	万民远先生,博士,8年证券投资从业经历,具有基金从业资格。2011年1月至2012年4月就职于中国银河证券任研究员,2012年5月至2014年4月就职于国海证券任研究员,2014年4月至2015年6月就职于融通基金管理有限公司任行业研究员,2015年6月至2016年6月就职于深圳前海明远睿达投资管理有限公司投资经理。2016年7月再次加入融通基金管理有限公司,曾任融通医疗保健行业混合型证券投资基金基金经理,现任融通健康产业灵活配置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

平常心看待行业增速下滑至新常态,药品降价是长期趋势,创新和产品更新才是行业的出路,研发投入型企业中长期将胜出。医药行业将进入"总量平稳增长,内部结构持续优化"的良性发展阶段。医保局成立后,中长期将促进国内药品价格趋于合理,国内仿制药中长期降价压力大(毛利率下降),产业趋势不可逆,"4+7"带量采购必然推广,鼓励优质低价仿制药替代原研。医保支出结构优化改善,创新药及器械(药械比)大扩容。全民医保时代控费将常态化,更多是压缩中间利益环节,腾笼换鸟,医保谈判将临床急需创新药降至合理价格,仿制药和辅助用药受挤压,投资应顺行业变革趋势寻找机会。

本基金按照基金契约规定要求,精选成长性较好且估值相对较低的个股进行重点配置,减配医保控费受损较大的相关标的,中线持股的心态从容守候,用时间换空间,并适时调整组合结构。截止二季度末,融通健康产业净值今年上涨49.83%,大幅跑赢医药行业指数,在医疗行业基金中表现良好,主要在于重点配置的个股前期超跌,今年以来反弹较好,同时基金持仓结构与医保关联度较低。目前基金重点布局零售药店、疫苗、创新药及IVD等医保关联度较低的高景气度资产,个股选择则坚持"逆向思维,人多的地方不去"原则,组合构建遵循产业趋势优先,成长与估值匹配,不追逐短期热点,提前预判,做孤独的"拐点型"价值发现者。

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1.302元;本报告期基金份额净值增长率为7.34%,业绩比较基准收益率为-5.33%。

4.6 报告期内基金持有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	124,154,851.31	91.17
	其中:股票	124,154,851.31	91.17
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	10,821,495.95	7.95
8	其他资产	1,195,691.97	0.88
9	合计	136,172,039.23	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	83,307.85	0.06
C	制造业	88,814,922.96	67.86
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	31,179,240.20	23.82
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	39,603.76	0.03
J	金融业	33,869.94	0.03
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	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,980,800.00	3.04
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.02
S	综合	-	-
	合计	124,154,851.31	94.86

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	002727	一心堂	472,980	13,475,200.20	10.30
2	300406	九强生物	806,800	12,166,544.00	9.30
3	603883	老百姓	188,000	10,994,240.00	8.40
4	000661	长春高新	28,900	9,768,200.00	7.46
5	300633	开立医疗	233,600	6,671,616.00	5.10
6	300241	瑞丰光电	1,102,700	6,550,038.00	5.00
7	000403	振兴生化	223,700	5,972,790.00	4.56
8	603538	美诺华	194,100	4,159,563.00	3.18
9	002044	美年健康	320,000	3,980,800.00	3.04
10	600216	浙江医药	383,211	3,924,080.64	3.00

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

本基金本报告期未持有股指期货。

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

本基金本报告期未持有国债期货。

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	140,313.62
2	应收证券清算款	584,699.16
3	应收股利	-
4	应收利息	2,410.68
5	应收申购款	468,268.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,195,691.97

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	94,302,181.29
报告期期间基金总申购份额	34,330,261.94
减:报告期期间基金总赎回份额	28,140,807.33
报告期期末基金份额总额	100,491,635.90

§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健康产业混合型证券投资基金设立的文件

(二)《融通健康产业混合型证券投资基金基金合同》

(三)《融通健康产业混合型证券投资基金托管协议》

(四)《融通健康产业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
2019年7月16日

融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)

2019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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月16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2019年7月12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2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通巨潮100指数(LOF)	
场内简称	融通巨潮	
基金主代码	161607	
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)	
基金合同生效日	2006年5月12日	
报告期末基金份额总额	620,310,499.47份	
投资目标	本基金为增强型指数基金。在控制股票投资组合相对巨潮100目标指数跟踪误差的基础上,力求获得超越巨潮100目标指数的投资收益,追求长期的资本增值。本基金谋求分享中国经济的持续、稳定增长和中国证券市场发展的成果,实现基金财产的长期增长,为投资者带来稳定的回报。	
投资策略	本基金为增强型指数基金,在控制股票投资组合相对目标指数偏离风险的基础上,力争获得超越目标指数的投资收益。基金以指数化分散投资为主要投资策略,在此基础上进行适度的主动调整,在数量化投资技术与基本面深入研究的结合中谋求基金投资组合在偏离风险及超额收益间的最佳匹配。为控制基金偏离目标指数的风险,本基金力求将基金份额净值增长率与目标指数增长率间的日跟踪误差控制0.5%。	
业绩比较基准	巨潮100指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%	
风险收益特征	风险和预期收益率接近市场平均水平	
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	
下属分级基金的基金简称	融通巨潮100指数A/B	融通巨潮100指数C
下属分级基金的交易代码	161607	004874
报告期末下属分级基金的份额总额	619,619,304.25份	691,195.22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(2019年4月1日-2019年6月30日)	
	融通巨潮100指数A/B	融通巨潮100指数C
1.本期已实现收益	23,994,975.48	18,585.48
2.本期利润	13,609,720.58	-291.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.0217	-0.0004
4.期末基金资产净值	760,142,228.98	756,248.21
5.期末基金份额净值	1.227	1.094

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

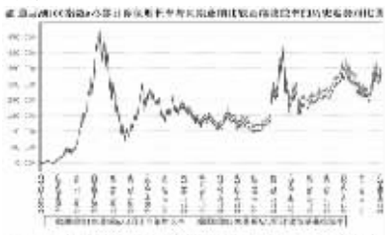
融通巨潮100指数A/B

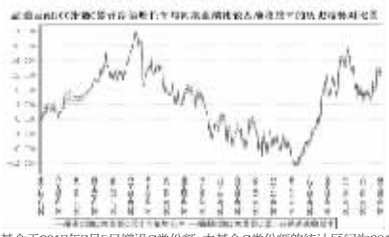
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.74%	1.50%	1.39%	1.45%	0.35%	0.05%

融通巨潮100指数C

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	1.67%	1.49%	1.39%	1.45%	0.28%	0.04%

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





注:本基金于2017年7月5日增设C类份额,本基金C类份额的统计区间为2017年7月6日至本报告期末。

§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		
蔡志伟	本基金的基金经理	2015-02-11	-	8	蔡志伟先生,计算机应用技术硕士,金融风险管理师(FRM),8年证券投资从业经历,具有基金从业资格。2006年7月至2008年8月就职于汇丰软件开发(广东)有限公司任高级软件工程师。2011年6月加入融通基金管理有限公司,历任风险管理专员、金融工程研究员,现任融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)基金经理、融通沪深成交价指数证券投资基金基金经理、融通创业板指数增强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

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思想,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,采取量化策略进行指数增强和风险管理,在控制基金相对巨潮100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巨潮100指数A/B基金份额净值为1.227元,本报告期基金份额净值增长率为1.74%;截至本报告期末融通巨潮100指数C基金份额净值为1.094元,本报告期基金份额净值增长率为1.67%;同期业绩比较基准收益率为1.39%。

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	724,504,576.60	94.90
	其中:股票	724,504,576.60	94.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	16,480,662.00	2.16
	其中:债券	16,480,662.00	2.16
	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	22,030,791.31	2.89
8	其他资产	462,628.57	0.06
9	合计	763,478,658.48	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	19,061,571.18	2.51
B	采矿业	12,749,876.57	1.68
C	制造业	231,140,370.12	30.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,523,058.00	1.12
E	建筑业	20,707,837.26	2.72
F	批发和零售业	6,986,816.00	0.92
G	交通运输、仓储和邮政业	16,333,368.94	2.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,145,106.23	1.60
J	金融业	316,936,591.99	41.65
K	房地产业	20,742,049.08	2.73
L	租赁和商务服务业	8,624,093.85	1.13
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	673,950,739.22	88.57

5.2.2 报告期末积极投资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	7,443,715.25	0.98
C	制造业	20,538,151.78	2.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,039,794.00	0.27
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,695,899.00	0.35
G	交通运输、仓储和邮政业	1,969,447.00	0.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,082,897.71	0.54
J	金融业	2,689,063.94	0.35
K	房地产业	5,357,917.00	0.70
L	租赁和商务服务业	1,275,440.00	0.17
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	1,806,480.10	0.24
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.00
S	综合	631,925.00	0.08
	合计	50,553,837.38	6.64

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	858,134	76,039,283.74	9.99
2	600519	贵州茅台	37,747	37,143,048.00	4.88
3	600036	招商银行	968,861	34,859,618.78	4.58
4	601166	兴业银行	1,254,431	22,943,542.99	3.02
5	000333	美的集团	419,837	21,772,746.82	2.86
6	000651	格力电器	361,299	19,871,445.00	2.61
7	000858	五粮液	163,524	19,287,655.80	2.53
8	600887	伊利股份	546,790	18,268,253.90	2.40
9	600276	恒瑞医药	251,776	16,617,216.00	2.18
10	300498	温氏股份	445,813	15,986,854.18	2.10

5.3.2 报告期末积极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	603160	汇顶科技	30,593	4,246,308.40	0.56
2	000975	银泰资源	185,400	2,445,426.00	0.32
3	002456	欧菲光	292,200	2,290,848.00	0.30
4	002463	沪电股份	165,300	2,251,388.00	0.30
5	600188	兖州煤业	197,700	2,148,999.00	0.28

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	1,005,200.00	0.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	15,475,462.00	2.03
	其中:政策性金融债	15,475,462.00	2.03
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	16,480,662.00	2.17

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	108901	农发1801	104,620	10,472,462.00	1.38
2	108603	国开1804	50,000	5,003,000.00	0.66
3	019603	15国债03	10,000	1,005,200.00	0.13

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

本基金本报告期未持有股指期货。

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

本基金本报告期未持有国债期货。

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	70,601.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	334,521.23
5	应收申购款	57,505.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	462,628.57

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

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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

项目	融通巨潮100指数A/B	融通巨潮100指数C
报告期期初基金份额总额	640,421,221.92	564,647.81
报告期期间基金总申购份额	7,943,079.39	661,143.19
减:报告期期间基金总赎回份额	28,744,997.06	534,595.78
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	619,619,304.25	691,195.22

§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巨潮100指数证券投资基金(LOF)设立的文件

(二)《融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)基金合同》

(三)《融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)托管协议》

(四)《融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)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、深圳证券交易所。

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
2019年7月16日

融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)

2019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:2019年7月16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2019年7月12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,投资者在做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2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通领先成长混合(LOF)
场内简称	融通领先
基金主代码	161610
前端交易代码	161610
后端交易代码	161660
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2007年4月30日
报告期末基金份额总额	3,030,088,555.94份
投资目标	本基金主要投资于符合中国经济发展方向,依靠技术自主创新、领先的经营模式或优势的品牌、渠道等因素获得业绩持续高速成长,从而推动中国经济结构提升的上市公司,分享中国经济发展过程中结构性的高速增长;通过积极主动的分散化投资策略,在严格控制风险的前提下实现基金资产的持续增长,为基金持有人获取长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金认为股价上升的主要推动力来自于企业盈利的不断增长。在中国经济长期高速增长的大背景下,许多企业在一定时期表现出较高的成长性,但只有符合产业结构发展趋势,同时在技术创新、经营模式、品牌、渠道、成本等方面具有领先优势的企业,才能保持业绩持续高速成长,而这些企业正是本基金重点投资的目标和获得长期超额回报的基础。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中债综合全价(总值)指数收益率×20%。
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(2019年4月1日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	69,268,171.06
2.本期利润	64,825,793.87
3.加权平均基金份额本期利润	0.0209
4.期末基金资产净值	3,238,065,909.53
5.期末基金份额净值	1.069

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。

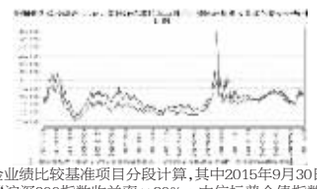
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	2.10%	1.74%	-0.90%	1.22%	3.00%	0.52%

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



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(含此日)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 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		
邹曦	本基金的基金经理、权益投资总监	2017/2/18	-	18	邹曦先生,中国人民银行研究生部金融学硕士,18年证券投资从业经历,具有基金从业资格。2001年2月加入融通基金管理有限公司,历任市场拓展部总监助理、机构理财部总监助理、行业分析师、宏观策略分析师、基金管理部总监、研究部总监、公司权益投资负责人、融通行业景气证券投资基金基金经理、融通内需驱动混合型证券投资基金基金经理、融通新能源汽车主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理,现任公司权益投资总监、融通行业景气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(LOF