融通新蓝筹证券投资基金

【2015】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:2015年10月23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2015年10月20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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通新蓝筹混合
交易代码	161601
前端交易代码	161601
后端交易代码	161602
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年9月13日
报告期末基金份额总额	3,357,434,174.39份
投资目标	主要投资于处于成长阶段和成熟阶段早期的“新蓝筹”上市公司。通过组合投资,在充分控制风险的前提下实现基金净值的稳定增长,为基金持有人获取长期稳定的投资收益。
投资策略	在对市场趋势判断的前提下,重视仓位选择和行业配置,同时更重视基本面分析,强调通过基本面分析挖掘个股。在正常市场状况下,股票投资比例浮动范围:30%-75%;债券投资比例浮动范围:20%-55%;权证投资比例浮动范围:0%-3%;现金留存比例浮动范围:不低于5%。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+中信标普全债指数收益率×25%
风险收益特征	在适度风险下追求较高收益
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(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	78,894,425.28
2.本期利润	-919,129,662.30
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2661
4.期末基金资产净值	3,585,364,397.76
5.期末基金份额净值	1.0679

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;

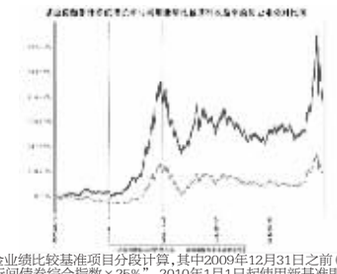
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-19.07%	2.83%	-21.26%	2.51%	2.19%	0.32%

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:上图中基金业绩比较基准项目分段计算,其中2009年12月31日之前(含此日)采用“国泰君安指数×75%+银行间债券综合指数×25%”,2010年1月1日起使用新基准即“沪深300指数收益率×75%+中信标普全债指数收益率×25%”。

§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		
何龙	本基金的基金经理	2015年8月29日	-	3	华中科技大学经济学学士,武汉大学金融学硕士,3年证券从业经验,具有基金从业资格。2012年7月加入融通基金管理有限公司,任金融研究员、策略研究员。
姚昆	本基金的基金经理	2012年7月25日	2015年8月29日	10	经济学硕士,具有证券从业资格。硕士毕业后即加入广发证券股份有限公司,任发展研究中心研究员,从事装备制造业上市公司研究工作。2007年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、部门总监助理。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年三季度,A股延续了始于月的去杠杆运动,在这个波动极端,动辄千股跌停或者涨停的季度里,上证50下跌19.87%,沪深300下跌28.39%,中小板指数下跌22%,创业板指数下跌22.57,成长股是这轮去杠杆的重灾区,系统性风险使得个股出现普遍极端跌幅。从行业上看,本季度低估值的银行股因为市场维稳力量和本身股息价值的支撑,跌幅较为有限,而高弹性的TMT和收去杠杆直接影响的券商板块跌幅居前。

在这轮股灾初期,考虑到流动性风险,新蓝筹适度增加了金融地产等低估稳定市值较大的资产的配置,降低了高风险高弹性的TMT环保等创业板相关资产配置。而在股灾后期,鉴于货币政策对利率的引导和无风险利率中期继续下降的趋势。我们继续维持了在利率敏感资产中地产的配置,但是考虑到去杠杆过程的结束,对风险偏好缓慢上升的判断,我们降低了金融股的配置比例;并增加了成长类资产的配置,我们当前的配置核心是传统行业的转型主题+景气组合,传统行业转型应是未来永恒不变的方向,我们看好供应链金融在未来行业整合转型中的作用。另外,信息领域的互联网+也是我们看好的方向。高景气方面,我们配置了传媒影视和农业板块。当前鉴于市场本身杠杆风险的释放以及海外联储加息风险的落地,市场风险偏好有望伴随着继续宽松的流动性而出现明显反弹。在此基础上,9月后半段我们增加了组合弹性。

展望2015年四季度,流动性的相对宽松预计将长期维持,政策上以十三五规划作为抓手来不断深化改革的思路也逐步清晰;经济数据依旧疲软,企业盈利仍有待时日。海外局势依然会有不确定性,油价的波动较大、美国何时开启加息周期以及日欧经济的复苏情况,都可能会对市场造成一定的影响。

经历过过去三个季度,市场从过热到缩量暴跌,基本上我们判断大的系统性风险应该不会再出现。看四季度,投资机会犹存;经过前期的市场暴跌,未来一段时间内市场的波动幅度可能趋于正常化,风险偏好会正常修复。加上流动性宽松大局不变。部分强势板块可能会维持高弹性。板块上,未来半年内我们看好在改革中充分释放效率的国企改革,军工等板块。成长股中,我们将更多的关注高端装备、环保和消费升级等领域的投资机会。

综上所述,融通新蓝筹基金将会继续坚持“核心周期龙头+优质成长股”的组合构建思路,精选个股,在保持结构基本稳定的同时精选个股,力争为持有人获取风险调整后的稳定收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为-19.07%,同期业绩比较基准收益率为-21.26%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	2,476,084,655.48	68.13
	其中:股票	2,476,084,655.48	68.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	862,609,000.00	23.74
	其中:债券	862,609,000.00	23.74
	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	277,800,704.44	7.64
8	其他资产	17,626,134.01	0.49
9	合计	3,634,120,493.93	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	1,515,865,032.39	42.28
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	103,548,346.84	2.89
J	金融业	79,174,834.07	2.21
K	房地产业	556,751,743.58	15.53
L	租赁和商务服务业	44,795,965.50	1.25
M	科学研究和技术服务业	82,265,048.40	2.29
N	水利、环境和公共设施管理业	33,709,383.25	0.94
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	59,974,301.45	1.67
S	综合	-	-
	合计	2,476,084,655.48	69.06

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	000024	招商地产	11,364,786	323,782,753.14	9.03
2	002085	万丰奥威	10,362,976	301,562,601.60	8.41
3	600687	刚泰控股	21,317,930	285,020,724.10	7.95
4	600240	华业资本	12,646,414	134,557,844.96	3.75
5	300145	南方泵业	3,500,000	120,855,000.00	3.37
6	002157	正邦科技	7,749,059	113,988,657.89	3.18
7	300090	盛运环保	6,000,000	108,360,000.00	3.02
8	600622	嘉宝集团	8,818,203	98,411,145.48	2.74
9	300285	国瓷材料	2,804,448	86,937,888.00	2.42
10	000407	胜利股份	13,308,753	82,381,181.07	2.30

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	862,609,000.00	24.06
	其中:政策性金融债	862,609,000.00	24.06
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	862,609,000.00	24.06

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	150307	15进出07	1,200,000	120,624,000.00	3.36
2	150206	15国开06	1,000,000	100,670,000.00	2.81
3	150211	15国开11	1,000,000	100,310,000.00	2.80
4	130237	13国开37	600,000	60,948,000.00	1.70
5	130238	13国开38	500,000	51,570,000.00	1.44

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

本基金本报告期末投资股指期货。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

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	2,779,465.78
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,479,140.24
5	应收申购款	367,527.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,626,134.01

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300145	南方泵业	120,855,000.00	3.37	资产重组

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	3,785,938,203.32
报告期期间基金总申购份额	85,125,652.99
减:报告期期间基金总赎回份额	513,629,681.92
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期末基金份额总额	3,357,434,174.39

§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	0.00
报告期期间买入/申购总份额	4,215,656.71
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	4,215,656.71
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.13

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	2015年7月15日	1,469,698.28	1,700,000.00	0.00%
2	网上直销申购	2015年7月16日	1,449,151.82	1,700,000.00	0.00%
3	网上直销申购	2015年7月17日	1,296,806.61	1,600,000.00	0.00%
合计			4,215,656.71	5,000,000.00	

§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蓝筹证券投资基金设立的文件
(二)《融通新蓝筹证券投资基金基金合同》
(三)《融通新蓝筹证券投资基金托管协议》
(四)《融通新蓝筹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
二〇一五年十月二十三日

融通新能源灵活配置混合型证券投资基金

【2015】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:2015年10月23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2015年10月20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2015年7月1日起至2015年9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	3,314,069,631.10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。
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(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-561,558,345.13
2.本期利润	-648,830,384.41
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1760
4.期末基金资产净值	2,764,312,324.56
5.期末基金份额净值	0.834

注:1.本基金合同生效日为2015年6月29日。

2.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。

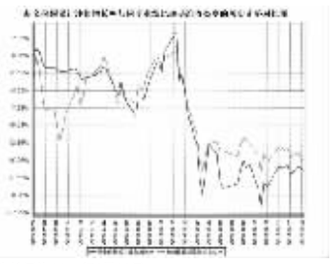
3.本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-17.51%	2.30%	-14.78%	2.03%	-2.73%	0.27%

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:1、本基金合同生效日为2015年6月29日。

2、本基金的建仓期为自基金合同生效日起6个月。截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

§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	2015年6月29日	-	5	毕业于清华大学,获物理学博士,5年证券从业经验,具有基金从业资格。2010年7月至2011年4月在中信证券工作,任研究员。2011年5月至2014年9月在瑞银证券工作,任研究员。2014年10月加入融通基金管理有限公司,任制造业组组长。
刘格菘	本基金、融通领先成长股票(LOF)、融通新区域新经济灵活配置混合、融通互联网传媒灵活配置混合的基金经理	2015年6月29日	-	5	经济学博士,毕业于中国人民银行研究生部,具有基金从业资格。曾任职于中国人民银行营业管理部,历任中邮核心成长股票型证券投资基金基金经理。2014年9月加入融通基金管理有限公司。

注:任职日期根据基金管理人对外披露的任职日期填写;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

2015年三季度,市场先是延续了二季度末的大幅调整,在7月初出现系统性暴跌,在救市的作用下,市场出现一波上涨。而八月下旬,又出现一次暴跌,并在九月中旬气温回升。三季度上证综指下跌28.63%,深证成指下跌30.34%,创业板下跌27.14%。

融通新能源成立于6月29日,主要仓位配置在新兴成长行业,包括新能源汽车、环保、消费升级、传媒等领域。成立最初一个月,仓位控制在20%以内,8月用较大仓位参与了国企改革主题行情,最高净值为1.034。但在8月的系统性暴跌中,尽管我们及时将仓位下降至较低水平,但净值仍出现了较大程度下滑。为了将回撤控制在相对较低的水平,基金仓位一直适中。

未来资产配置的方向将集中在新兴成长方向,因为我们认为,创新和转型是未来的方向。目前中国经济结构分化明显,重化工领域依然在持续下降,而以新消费升级为代表的“物质消费”向“精神消费”转化的动力依然强劲。从细分行业的角度看,新能源汽车、大数据、大健康以及以娱乐、教育、体育、旅游为主的消费升级、环保等是配置的重点。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为-17.51%,同期业绩比较基准收益率为-14.78%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	1,456,647,294.04	48.96
	其中:股票	1,456,647,294.04	48.96
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	1,514,906,776.10	50.92
8	其他资产	3,343,864.35	0.11
9	合计	2,974,897,934.49	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	801,985,937.95	29.01
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	201,909,510.00	7.30
H	住宿和餐饮业	47,998,296.00	1.74
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	166,324,862.07	6.02
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	89,746,733.10	3.25
N	水利、环境和公共设施管理业	96,133,726.04	3.48
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	52,548,228.88	1.90
S	综合	-	-
	合计	1,456,647,294.04	52.69

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	601021	春秋航空	1,799,550	201,909,510.00	7.30
2	000068	*ST华赛	14,079,017	136,848,045.24	4.95
3	600622	嘉宝集团	11,038,970	123,194,905.20	4.46
4	000559	万向钱潮	4,995,246	96,807,867.48	3.50
5	002466	天齐锂业	1,499,905	95,153,973.20	3.44
6	002594	比亚迪	1,499,869	90,007,138.69	3.26
7	300012	华测检测	4,999,818	89,746,733.10	3.25
8	600072	钢构工程	4,500,000	81,090,000.00	2.93
9	002672	东江环保	3,499,841	62,437,163.44	2.26
10	600418	江淮汽车	4,300,000	57,104,000.00	2.07

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

本基金本报告期末投资股指期货。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

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	2,556,826.16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	282,407.24
5	应收申购款	504,630.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,343,864.35

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600072	钢构工程	81,090,000.00	2.93	重大资产重组

§6 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日基金份额总额	3,964,088,729.27
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	68,247,790.16
减:基金合同生效日起至报告期末总赎回份额	718,266,888.33
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额	-
报告期末基金份额总额	3,314,069,631.10

§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	5,357,984.99
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	5,357,984.99
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.16

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	2015年7月31日	5,357,984.99	5,000,000.00	0.02%
合计			5,357,984.99	5,000,000.00	

§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基金设立的文件
(二)《融通新能源灵活配置混合型基金基金合同》
(三)《融通新能源灵活配置混合型基金托管协议》
(四)《融通新能源灵活配置混合型基金招募说明书》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
二〇一五年十月二十三日

融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金

【2015】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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月23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2015年10月20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2015年7月1日起至2015年9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	2,461,711,429.83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期超配股票资产;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(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-818,088,051.43
2.本期利润	-647,352,357.62
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2505
4.期末基金资产净值	1,487,194,640.02
5.期末基金份额净值	0.604

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损益。

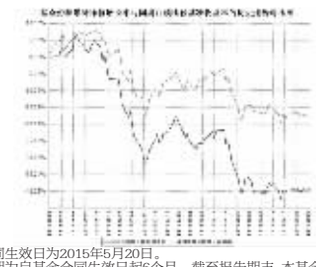
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-27.84%	2.79%	-13.88%	2.07%	-13.96%	0.72%

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:1、本基金合同生效日为2015年5月20日。

2、本基金的建仓期为自基金合同生效日起6个月。截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

§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		
刘格菘	本基金、融通新能源灵活配置混合、融通领先成长混合(LOF)、融通互联网传媒灵活配置混合的基金经理	2015年5月20日	-	5	经济学博士,毕业于中国人民银行研究生部,曾任职于中国人民银行营业管理部,历任中邮创业基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、中邮核心成长股票型证券投资基金基金经理。2014年9月加入融通基金管理有限公司。
杨博琳	本基金、融通动力先锋混合、融通内需驱动混合的基金经理	2015年5月20日	-	5	金融学硕士,毕业于北京大学光华管理学院,5年证券从业经验,具有基金从业资格。2010年7月至2014年12月在华夏基金管理有限公司投资研究部工作,历任研究员、TMT研究组