融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)

【2015】第四季度报告

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:2016年1月22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2016年1月18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10月1日起至2015年12月31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
交易代码	161607
前端交易代码	161607
后端交易代码	161657
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年5月12日
报告期末基金份额总额	825,119,992.48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

§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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	239,894.69
2.本期利润	121,136,387.96
3.加权平均基金份额本期利润	0.1432
4.期末基金资产净值	897,536,897.17
5.期末基金份额净值	1.088

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。

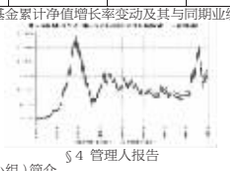
(2)本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	14.89%	1.55%	14.86%	1.54%	0.03%	0.01%

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		
李勇	本基金、融通深证成份指数、融通创业板指数的基金经理	2015年1月9日	-	11	研究生学历,具有证券从业资格。2005年至今就职于融通基金管理有限公司,历任金融工程研究员、基金经理助理职务。
蔡志伟	本基金的基金经理	2015年2月11日	-	3	硕士,具有基金从业资格。2006年7月至2008年8月在汇丰软件开发广东有限公司工作,任高级软件工程师;2011年6月加入融通基金管理有限公司,任金融工程研究员。

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 报告期内基金的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,通过控制股票投资权重与巨潮100指数成份股自然权重的偏离,减少基金相对巨潮100指数基金基准的跟踪误差,力求最终实现对巨潮100指数基金基准的有效跟踪。

沪深300上涨16.49%,从各行业指数的表现来看,各行业普涨,其中:电子(申万)、房地产(申万)和计算机(申万)涨幅较大,分别上涨41%、39.8%和39.3%。

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14.89%,同期业绩比较基准收益率为14.86%。

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	853,708,582.34	94.72
	其中:股票	853,708,582.34	94.72
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	47,285,472.28	5.25
7	其他资产	312,809.82	0.03
8	合计	901,306,864.44	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	-	-
B	采矿业	25,014,337.21	2.79
C	制造业	192,817,112.91	21.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,788,394.97	2.43
E	建筑业	30,702,624.86	3.42
F	批发和零售业	6,884,195.00	0.77
G	交通运输、仓储和邮政业	9,743,913.12	1.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,909,404.70	2.66
J	金融业	398,389,535.03	44.39
K	房地产业	34,335,711.48	3.83
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,957,856.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	745,543,085.28	83.08

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	采掘业	2,431,506.00	0.27
C	制造业	87,159,654.57	9.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,359,149.78	0.26
F	批发和零售业	4,964,107.72	0.55
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	10,102,044.76	1.13
J	金融业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	1,149,034.23	0.13
	合计	108,165,497.06	12.05

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	601166	兴业银行	3,988,882	68,090,215.74	7.59
2	601318	中国平安	1,276,834	45,966,024.00	5.12
3	601288	农业银行	11,889,208	38,402,141.84	4.28
4	600030	中信证券	1,674,679	32,405,038.65	3.61
5	600016	民生银行	3,179,754	30,652,828.56	3.42
6	601668	中国建筑	3,222,013	20,427,562.42	2.28
7	600048	保利地产	1,870,232	19,899,268.48	2.22
8	600519	贵州茅台	85,527	18,661,136.13	2.08
9	600015	华夏银行	1,512,304	18,359,370.56	2.05
10	601766	中国中车	1,113,822	14,312,612.70	1.59

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	300146	汤臣倍健	278,100	10,706,850.00	1.19
2	600066	宇通客车	439,474	9,883,770.26	1.10
3	600177	雅戈尔	599,300	9,756,604.00	1.09
4	300124	汇川技术	202,900	9,576,880.00	1.07
5	002236	大华股份	246,000	9,077,400.00	1.01

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、处罚的情形

2015年11月26日,中信证券股份有限公司收到中国证券监督管理委员会调查通知书,因公司涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定,中国证监会决定对公司进行立案调查。

本基金依照法律法规及基金合同的约定,采取指数化投资策略,紧密跟踪标的指数。

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	230,945.69
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,021.05
5	应收申购款	71,843.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	312,809.82

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

报告期期初基金份额总额	861,478,595.06
报告期期间基金总申购份额	8,800,090.94
减:报告期期间基金总赎回份额	45,158,693.52
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	825,119,992.48

§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

本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
2016年1月22日

融通健康产业灵活配置混合型证券投资基金

【2015】第四季度报告

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:2016年1月22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2016年1月15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10月1日起至2015年12月31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
交易代码	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	303,454,629.43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(2015年10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	35,916,135.14
2.本期利润	112,024,773.05
3.加权平均基金份额本期利润	0.3611
4.期末基金资产净值	423,284,990.80
5.期末基金份额净值	1.395

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。

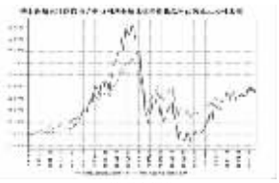
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	38.67%	2.21%	18.03%	1.36%	20.64%	0.85%

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		
蒋秀蕾	本基金、融通医疗保健混合的基金经理	2014年12月25日	-	8	药物化学硕士学位,具有基金从业资格。2006年8月起,先后担任明生医药(深圳)有限公司产品经理、招商证券研发中心研究员、嘉联融丰投资有限公司投资经理。2009年2月加入融通基金管理有限公司,先后担任研究策划部行业研究员、行业组长。

注:任职日期指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

2015年第四季度,市场反弹态势明确,创业板为代表的中小型上市公司反弹为龙头,一大批战略新兴产业板块如新能源、影视传媒、虚拟现实、精准医疗表现持续活跃,转型和创新是四季度A股市场的主题词,而传统产业继续处于去库存去产能的阶段,除地产、券商外基本没有明显机会。医药行业本身行业数据显示(1-11月份统计局公布行业收入增长9%,利润增长13.6%)继续延续低增长状态,子行业来看,中药行业涨幅最大。第四季度申万医药指数上涨25.3%,跑赢沪深300指数8.9个百分点,整体涨跌幅居28个申万一级子行业第12位。

健康产业基金从2014年12月份成立以来,按照基金契约规定要求,根据市场形势,在四季度寻求进攻,重点布局转型大健康产业的个股以及代表未来医药发展新方向的标的,如养老、康复、精准医疗、智慧医疗和第三方影像。

展望16年一季度,供给侧改革带动传统产业去产能、国企改革以及创新都孕育着很大的机会,流动性继续保持宽松环境,资本市场在去杠杆结束后将逐步恢复常态。传统医药行业内部,医疗体制改革和年底的药品招标将带动行业走出底部,行业经济数据预计将企稳回升,创新类资产上精准医疗和医药电商依然是行业未来发展的大方向。此外养老、康复、第三方影像等新兴方向将支撑未来大健康行业发展的新格局。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内基金份额净值增长率为38.67%,同期业绩比较基准收益率为18.03%。

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	395,762,213.08	91.88
	其中:股票	395,762,213.08	91.88
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,001,000.00	2.32
	其中:债券	10,001,000.00	2.32
	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	23,177,960.13	5.38
8	其他资产	1,775,997.14	0.41
9	合计	430,717,170.35	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	4,994,000.00	1.18
B	采矿业	-	-
C	制造业	268,410,233.01	63.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,044,000.00	1.19
F	批发和零售业	77,784,980.07	18.38
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	12,420,000.00	2.93
J	金融业	-	-
K	房地产业	16,616,000.00	3.93
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	10,493,000.00	2.48
S	综合	-	-
	合计	395,762,213.08	93.50

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	600682	南京新百	1,161,300	38,299,674.00	9.05
2	000403	ST生化	1,200,000	35,208,000.00	8.32
3	002584	西陇科学	679,050	33,680,880.00	7.96
4	002562	兄弟科技	731,112	21,056,025.60	4.97
5	600420	现代制药	500,000	20,885,000.00	4.93
6	600351	亚宝药业	1,200,000	18,744,000.00	4.43
7	000638	万方发展	600,005	18,330,152.75	4.33
8	603998	方盛制药	300,010	15,309,510.30	3.62
9	002172	澳洋科技	1,000,000	14,880,000.00	3.52
10	000756	新华制药	1,000,050	13,410,670.50	3.17

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	10,001,000.00	2.36
	其中:政策性金融债	10,001,000.00	2.36
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	10,001,000.00	2.36

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	018001	国开1301	100,000	10,001,000.00	2.36

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、处罚的情况。

本基金投资的ST生化(000403)在报告编制日(2015年12月31日)前一年内受到过公开谴责、处罚,分别是14年7月2日、14年8月8日和14年9月16日公告收到中国证券监督管理委员会山西监管局《行政监管措施决定书》的公告,公司经过整改后于14年12月20日发布整改情况说明公告,公告显示公司已经对“唯康药业公司治理结构、内控、老厂区土地转让会计核算不规范、停建公告和整体搬迁改造过程中运作不规范情况”进行了整改。公司后面又于15年1月10日收到中国证监会行政处罚决定书的公告,公告显示针对公司13年底因一些违法事实(主要是信息披露方面的问题)证监会立案调查后,公司积极配合调查,证监会给出了相应的行政处罚决定(主要是罚款和当事人给予警告),公司公告接受证监会的处罚,不申请行政复议和提起行政诉讼,将在规定时间内缴纳罚款,并诚恳地向投资者致歉。另外,公司又于15年12月18日收到中国证监会行政处罚决定书的公告,显示公司在筹划重大资产重组过程中存在信息披露不及时不准确的问题,给予公司出具警示函的监管措施。

本基金投资的现代制药(600420)在报告编制日(2015年12月31日)前一年内受到过公开谴责、处罚,于2015年6月25日收到证监会上海监管局对公司前任董事冯鸣先生的行政处罚决定,决定对于其2014年间的短线交易行为给予警告。

本基金本着严格的公司流程和基本面的分析投资ST生化、现代制药,内外部报告、入股票库和投资环节都符合相关投资决策规定。

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	672,691.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	582,889.25
5	应收申购款	520,416.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,775,997.14

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	600682	南京新百	38,299,674.00	9.05	重大资产重组事项
2	600420	现代制药	20,885,000.00	4.93	重大资产重组事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	261,902,562.25
报告期期间基金总申购份额	133,142,636.31
减:报告期期间基金总赎回份额	91,590,569.13
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	303,454,629.43

§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》

(五)《融通基金管理有限公司开放式基金业务管理规则》

(六)融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照

(七)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www.rtfund.com查询。

融通基金管理有限公司
2016年1月22日

融通互联网传媒灵活配置混合型证券投资基金

【2015】第四季度报告

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:2016年1月22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2016年1月16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2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通互联网传媒灵活配置混合
交易代码	001150
前端交易代码	001150
后端交易代码	001151
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月16日
报告期末基金份额总额	4,765,499,289.49份
投资目标	通过主要投资于互联网传媒相关优质上市公司,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。
业绩比较基准	50%×沪深300指数收益率+50%×中债综合(全价)指数收益率
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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	114,487,695.20
2.本期利润	942,336,691.04
3.加权平均基金份额本期利润	0.1901
4.期末基金资产净值	3,939,434,062.65
5.期末基金份额净值	0.827

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	29.02%	2.65%	9.15%	0.83%	19.87%	1.82%

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4月16日。

2、本基金的建仓期为自合同生效日起6个月,截止报告期末,各项资产配置比例符合规定。

§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		
林清源	本基金、融通内需驱动混合的基金经理	2015年5月12日	-	4	毕业于宾夕法尼亚大学,获系统工程硕士。4年证券从业经验,具有基金从业资格。2011年7月加入融通基金管理有限公司,历任融通基金互联网传媒行业、家电行业、计算机行业分析师。
刘格菘	本基金、融通领先成长混合(LOF)、融通新区域新经济灵活配置混合、融通新能源灵活配置混合、融通成长30灵活配置混合的基金经理	2015年4月16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基金经理。2014年9月加入融通基金管理有限公司。
张鹏	本基金的基金经理	2015年8月29日	-	3	大连理工大学理学学士,复旦大学理学硕士。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,任信息服务、通信行业研究员。
伍文友	本基金的基金经理、融通领先成长混合(LOF)	2015年11月17日	-	5	毕业于中国人民银行研究部,获金融学硕士。5年证券从业经验,具有基金从业资格。历任中国人寿资产管理有限公司助理研究员、建信基金管理有限公司研究员。2015年5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