融通成长30灵活配置混合型证券投资基金

【2016】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:2017年1月20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2017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2016年10月01日起至2016年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通成长30灵活配置混合
交易代码	002252
前端交易代码	002252
后端交易代码	002253
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年12月11日
报告期末基金份额总额	450,367,435.46份
投资目标	本基金通过精选个股和集中投资,在科学严格管理风险的前提下,谋求基金资产的持续稳健增值。
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(2016年10月1日 - 2016年12月31日)
1.本期已实现收益	-6,369,101.11
2.本期利润	-20,856,535.41
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0429
4.期末基金资产净值	434,729,203.89
5.期末基金份额净值	0.965

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	-4.83%	0.78%	-0.27%	0.39%	-4.56%	0.39%

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12月11日。

2、本基金的建仓期为自合同生效日起6个月,截止建仓期结束,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		
刘格菘	融通领先成长混合型证券投资基金(LOF),融通互联网传媒灵活配置混合型证券投资基金,融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金,融通成长30灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。	2015年12月11日	-	6	刘格菘先生,中国人民银行研究生部经济学博士,金融学硕士,东北财经大学国际金融学士,6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权益投资部总经理,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的基金经理。2014年5月加入融通基金管理有限公司,2014年12月24日起至今任"融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)"基金经理,2015年4月16日起至今任"融通互联网传媒灵活配置混合型证券投资基金"基金经理,2015年5月20日起至今任"融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金"基金经理,2016年12月11日起至今任"融通成长30灵活配置混合型证券投资基金"基金经理。

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

本基金成立于2015年四季度末,主要投资策略是围绕经济转型和消费升级的大背景,寻找中长期成长趋势确定性较强以及景气拐点向上的行业。一方面,坚持自下而上精选个股,按照行业景气度、细分市场空间、企业战略、管理层执行力、企业竞争力等几个角度,挖掘优质成长个股;另一方面,从行业政策导向、竞争格局、供需结构、景气度等角度把握板块轮动的投资机会,以此获得中长期投资回报。

2016年,随着稳增长政策的逐步落实及改革的不断推进,市场对经济前景的担忧在减弱;同时,随着供给侧改革的逐步推进,市场对改革的信心有了恢复的迹象。改革、转型、升级和创新仍然是我国经济发展的主线,决策层推动供给侧改革、国企改革、新消费、战略新兴产业的政策意图较为明显。

2016年下半年以来,国内股市逐步趋于稳定,市场对于业绩确定性的偏好在提升,因此行业及公司内生性成长的质量将是关键,同时还要求合理的估值即"好价格"。我们围绕"好公司"和"好价格"这两个核心要素进行行业和个股选择。我们认为,中长期成长性比较确定的行业包括军民融合、自主可控、人工智能、小家电、新材料、半导体、精品内容制作、节能环保等,中期比较确定的投资机会可能来自农产品及资源品的价格复苏,以及具有惠民生和稳增长功效的新基建等。我们认为供给侧改革有利于从中长期角度扭转产能过剩的局面,部分传统行业可能面临阶段性景气拐点;同时,我们更加期待以增加有效供给满足潜在需求的供给侧改革。

2016年,本基金围绕优质成长个股及热点板块,灵活把握仓位,力争获取绝对收益,并择机配置具备中长期投资价值的优质个股。我们主要围绕公司内生成长及低估值两个核心要素进行选股,同时适当关注热点板块的主题投资机会。自成立以来,自下而上精选个股为主的投资策略取得了比较好的效果。

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-4.83%,同期业绩比较基准收益率为-0.27%。

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	217,840,883.86	45.60
	其中:股票	217,840,883.86	45.60
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	258,935,958.86	54.20
8	其他资产	953,223.68	0.20
9	合计	477,730,066.40	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	203,593,049.86	46.83
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	-	-
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	14,247,834.00	3.28
S	综合	-	-
	合计	217,840,883.86	50.11

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	603011	合锻智能	3,483,601	40,200,755.54	9.25
2	002322	理工环科	1,560,100	37,223,986.00	8.56
3	000687	华讯方舟	1,499,898	23,038,433.28	5.30
4	600519	贵州茅台	59,992	20,046,326.80	4.61
5	300316	晶盛机电	1,499,940	17,969,281.20	4.13
6	002488	金固股份	1,008,500	16,741,100.00	3.85
7	300426	唐德影视	499,924	14,247,834.00	3.28
8	600160	巨化股份	1,200,000	12,696,000.00	2.92
9	600809	山西汾酒	499,999	12,509,974.98	2.88
10	002568	百润股份	599,939	12,142,765.36	2.79

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

本基金本报告期未投资国债期货。

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,没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	926,220.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	27,003.53
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	953,223.68

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	550,603,164.20
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	100,235,728.74
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期末基金份额总额	450,367,435.46

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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)《融通成长30灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

(二)《融通成长30灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(三)《融通成长30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成长30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

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
2017年1月20日

融通创业板指数增强型证券投资基金

【2016】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:2017年1月20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2017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2016年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通创业板指数
交易代码	161613
前端交易代码	161613
后端交易代码	161663
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年4月6日
报告期末基金份额总额	480,862,145.74份
投资目标	本基金在基金合同规定的范围内,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,结合增强收益的主动投资,力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度控制在0.5%以内,年化跟踪误差控制在7.75%以内,基金总体投资业绩超越创业板指数的表现。
投资策略	本基金为增强型指数基金,对指数投资部分,采用完全复制指数的投资策略,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。本基金对主动投资部分采取积极配置策略,力争在跟踪误差控制范围内,获取超越基准的业绩表现。
业绩比较基准	创业板指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,属于高风险高收益的基金品种,其收益和风险均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
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(2016年10月1日 - 2016年12月31日)
1.本期已实现收益	-8,569,156.67
2.本期利润	-39,693,186.04
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0908
4.期末基金资产净值	465,599,367.45
5.期末基金份额净值	0.968

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。

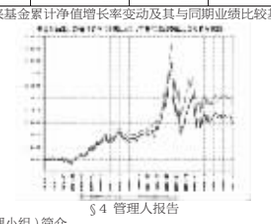
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-8.25%	1.03%	-6.82%	1.02%	-1.43%	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	融通深证成份指数证券投资基金、融通创业板指数增强型证券投资基金、融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)的基金经理	2012年4月6日	-	11	李勇先生,厦门大学经济学硕士、安徽大学数学学士,11年证券投资从业经历,具有基金从业资格,2006年1月入职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。2010年11月15日起至今任"融通深证成份指数证券投资基金"基金经理,2012年4月6日起至今任"融通创业板指数增强型证券投资基金"基金经理,2015年1月9日起至今任"融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)"基金经理。
蔡志伟	融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)的基金经理、融通深证成份指数证券投资基金、融通创业板指数增强型证券投资基金的基金经理。	2016年11月19日	-	5	蔡志伟先生,华南师范大学计算机硕士、广州大学计算机学士,金融风险管理师(FRM),5年证券投资从业经历,具有基金从业资格。曾就职于汇丰软件开发广东有限公司任高级软件工程师(SSE)。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,2015年2月11日起至今任"融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)"基金经理,2016年11月19日起至今任"融通深证成份指数证券投资基金"、"融通创业板指数增强型证券投资基金"基金经理。

注:1.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。

2. 自2017年1月7日起,李勇先生不再担任本基金的基金经理,由蔡志伟先生继续担任本基金的基金经理,具体内容请参阅2017年1月7日在《上海证券报》、《中国证券报》及《证券时报》上刊登的公告。

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,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

本基金在基金合同规定的范围内,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,结合增强收益的主动投资,力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度控制在0.5%以内、年化跟踪误差控制在7.75%以内、基金总体投资业绩超越创业板指数的表现。

当前国内经济延续平稳态势,通胀或逐步温和回升,在经济企稳背景下资金将"脱虚向实",同时监管层加大了去杠杠和严监管的力度,金融市场资金供给将受到挤压。在此背景下,我们看到政策在稳增长和改革转型方面正有序的不断推进,供给侧改革、PPP项目持续推进;同时,创新仍是拉动经济增长的重要推动力之一,新兴产业仍是未来中国经济的主要发展方向和新的增长点。随着去杠杆和监管趋严,市场资金面和情绪面都将受到抑制,尤其是题材炒作等投机行为将受到严厉监管,投资将更加回归基本面。市场仍将存在结构性行情:随着供给侧改革以及稳增长政策推进,传统周期板块如基建和PPP相关等产业将受益;其次,中长期的潜在的通胀风险也将提升传统消费板块和资源品的投资价值;此外,创新和新兴成长的步伐没有停止,随着政策支持、商业模式创新以及业绩推动的进度,新能源、云计算、虚拟现实、人工智能、以及军工电子等都存在阶段性的结构性机会。

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-8.25%,同期业绩比较基准收益率为-6.82%。

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	437,643,217.59	93.34
	其中:股票	437,643,217.59	93.34
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	28,025,862.33	5.98
8	其他资产	3,205,487.23	0.68
9	合计	468,874,567.15	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	5,314,204.92	1.14
B	采矿业	-	-
C	制造业	206,748,925.44	44.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,070,985.92	1.09
F	批发和零售业	2,365,440.00	0.51
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	154,500,285.42	33.18
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	8,002,796.34	1.72
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	11,856,432.24	2.55
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	12,537,750.02	2.69
R	文化、体育和娱乐业	29,392,701.39	6.31
S	综合	-	-
	合计	435,789,530.69	93.60

5.2.2 报告期末积极投资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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	511,917.54	0.11
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	1,341,769.36	0.29
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	-	-
	合计	1,853,686.90	0.40

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	300059	东方财富	940,017	15,914,487.81	3.42
2	300070	碧水源	676,737	11,856,432.24	2.55
3	300072	三聚环保	254,278	11,770,529.62	2.53
4	300104	乐视网	327,067	11,708,998.60	2.51
5	300017	网宿科技	217,672	11,669,395.92	2.51
6	300024	机器人	492,979	10,539,891.02	2.26
7	300124	汇川技术	448,430	9,116,581.90	1.96
8	300136	信维通信	300,380	8,560,830.00	1.84
9	300027	华谊兄弟	717,285	7,890,135.00	1.69
10	300408	三环集团	474,871	7,540,951.48	1.62

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	300300	汉鼎宇佑	51,752	1,084,721.92	0.23
2	300295	三六五网	8,550	247,009.50	0.05
3	002831	裕同科技	2,219	153,554.80	0.03
4	002232	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.02
5	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.01

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

本基金本报告期未投资股指期货。

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	60,513.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,536.99
5	应收申购款	3,084,146.28
6	其他应收款	54,290.28
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,205,487.23

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

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	300104	乐视网	11,708,998.60	2.51	重大资产重组

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

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	300583	赛托生物	63,738.78	0.01	新股锁定

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	414,616,646.47
报告期期间基金总申购份额	205,050,162.57
减:报告期期间基金总赎回份额	138,804,663.30
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	480,862,145.74

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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创业板指数增强型证券投资基金设立的文件

(二)《融通创业板指数增强型证券投资基金基金合同》

(三)《融通创业板指数增强型证券投资基金托管协议》

(四)《融通创业板指数增强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www.rtfund.com查询。

融通基金管理有限公司
2017年1月20日

融通增祥债券型证券投资基金

【2016】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:江苏银行股份有限公司
报告送出日期:2017年1月20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。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017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2016年10月1日起至2016年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通增祥债券
交易代码	002719
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年5月13日
报告期末基金份额总额	230,063,164.16份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的具体投资策略包括资产配置策略、固定收益类资产投资策略、股票投资策略、权证投资策略以及国债期货投资策略等部分。
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,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,高于货币市场基金。
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	江苏银行股份有限公司

§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(2016年10月1日 - 2016年12月31日)
1.本期已实现收益	3,130,715.75
2.本期利润	-837,204.77
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0036
4.期末基金资产净值	235,403,570.97
5.期末基金份额净值	1.023

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。

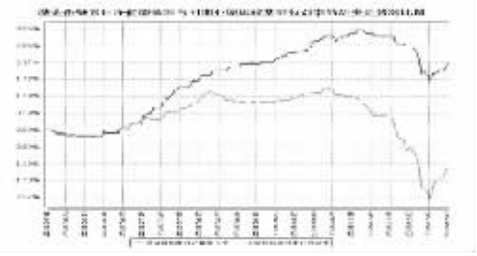
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-0.39%	0.10%	-2.32%	0.15%	1.93%	-0.05%

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2016年5月13日,至报告期末基金成立未满1年。

2、本基金的建仓期为自合同生效日起6个月,截止建仓期结束,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		
张一格	融通易支付货币市场证券投资基金、融通通盈保本混合型证券投资基金、融通增铃债券型证券投资基金、融通增祥债券型证券投资基金、融通增利丰债券型证券投资基金、融通通瑞债券型证券投资基金、融通通优债券型证券投资基金、融通月月添利定期开放债券型证券投资基金、融通通景灵活配置混合型证券投资基金、融通通鑫灵活配置混合型证券投资基金、融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金、融通通裕债券型证券投资基金的基金经理。	2016年5月13日	-	10	张一格先生,中国人民银行研究生部经济学硕士、南开大学法学学士,美国特许金融分析师(CFA)。10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经理,历任兴业银行资金营运中心投资经理、国泰基金管理有限公司国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、国泰上证5年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰信用债券型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金基金经理,2015年6月加入融通基金管理有限公司,2015年11月17日起至今任"融通易支付货币市场证券投资基金"基金经理,2016年3月15日起至今任"融通通盈保本混合型证券投资基金"基金经理,2016年4月28日起至今任"融通增铃债券型证券投资基金"基金经理,2016年5月13日起至今任"融通增祥债券型证券投资基金"基金经理,2016年7月19日起至今任"融通增丰债券型证券投资基金"基金经理,2016年7月28日起至今任"融通通瑞债券型证券投资基金"基金经理,2016年8月9日起至今任"融通通优债券型证券投资基金"基金经理,