

## 融通新趋势灵活配置混合型证券投资基金

[2016] 第四季度报告

2016年12月31日

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。

基金经理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。

本报章中财务数据未经审计。

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	融通新趋势灵活配置混合
交易代码	002565
前缀交易代码	002565
赎回交易代码	002566
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年3月17日
报告期末基金资产总额	363,234,712.15

§ 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.本期实现收益	-2,392,071.27
2.期初利润	-13,364,580.00
3.本期利润总额本期利润	-30,041
4.期末基金份额净值	363,931,208.76
5.期末总资产净值	363,931,208.76

注：1.本期已实现收益指本基金本期利息收入、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。

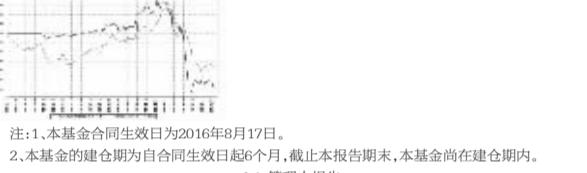
2.本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金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( % )	净值增长率标准差( % )	业绩比较基准收益率( % )	业绩比较基准收益率标准差( % )	①-③	②-④
过去三个月	-3.80%	0.64%	-0.27%	0.30%	-3.63%	0.26%

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8月17日。

2.本基金的建仓期为自合同生效之日起6个月，截止本报告期末，本基金尚在建仓期内。

## § 4 管理人报告

4.1 基金经理（基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
何天翔	融通深证100指数型证券投资基金、融通中证军工指数型证券投资基金、融通深证信息行业指数型证券投资基金、融通深证医药行业指数型证券投资基金、融通深证资源行业指数型证券投资基金、融通深证环保行业指数型证券投资基金、融通深证TMT行业指数型证券投资基金、融通深证医药行业指数型证券投资基金、融通深证资源行业指数型证券投资基金、融通深证环保行业指数型证券投资基金的基金经理。	2016年8月17日	-	8	

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 管理人报告期内本基金运作合规性情况的说明

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 报告期内本基金投资策略和运作分析

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。

## 4.5 报告期基金的业绩表现

本基金报告期内基金净值增长率为-3.80%，同期业绩比较基准收益率为-0.27%。

## 4.6 报告期本基金持有人数或基金份额净值预告说明

无。

## § 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

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.本期实现收益	-58,961,160.49
2.期初利润	-69,054,154.89
3.本期利润总额本期利润	-2,025.60
4.期末基金份额净值	1,099,002,070.96

5.2 报告期本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( % )	净值增长率标准差( % )	业绩比较基准收益率( % )	业绩比较基准收益率标准差( % )	①-③	②-④
过去三个月	-5.90%	1.22%	-2.14%	0.41%	-3.76%	0.81%

5.3 报告期本基金份额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.本期已实现收益指本基金本期利息收入、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将低于所列数字。

## 5.4 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期内基金净值增长率为-3.80%，同期业绩比较基准收益率为-0.27%。

## 5.5 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年四季度，上证综指下跌3.29%，深证成指下跌3.69%，创业板下跌0.74%，大小盘之间风格分化巨大，以中创建筑、格力电器为代表的权重股在大市值股的背景下，也有亮眼的表现。与此同时，成长股整体表现较为弱势，成交量较为萎靡。

融通区域新经济在四季度重点配置方向为新能源汽车、快递物流等板块，在10月份表现较好，但在之后的两个多月这个板块出现大幅度的回撤，给基金带来较大的负面影响。基金在四季度也适当参与了新能源汽车的布局，有出色的表现，但整体来看，基金在四季度的表现并不理想。

## 5.6 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期内基金净值增长率为-5.90%，同期业绩比较基准收益率为-2.14%。

## 5.7 报告期内基金持有数或基金份额净值预告说明

无。

## § 6 开放式基金份额变动

6.1 报告期末基金资产组合情况

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.本期实现收益	-58,961,160.49
2.期初利润	-69,054,154.89
3.本期利润总额本期利润	-2,025.60
4.期末基金份额净值	1,099,002,070.96

5.8 报告期内基金资产组合情况

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.本期实现收益	-58,961,160.49
2.期初利润	-69,054,154.89
3.本期利润总额本期利润	-2,025.60
4.期末基金份额净值	1,099,002,070.96

5.9 报告期内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( % )	净值增长率标准差( % )	业绩比较基准收益率( % )	业绩比较基准收益率标准差( % )	①-③	②-④
过去三个月	-5.90%	1.22%	-2.14%	0.41%	-3.76%	0.81%

5.10 报告期内基金份额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.本期已实现收益指本基金本期利息收入、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将低于所列数字。

## 5.11 基金净值表现

本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。

5.12 报告期内基金资产组合情况

单位：人民币元

主要财务指标	报告期( 2016年10月
--------	---------------