

# 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先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期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	融通新趋势灵活配置混合
交易代码	002656
融通交易代码	002656
融通交易简称	002656
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年09月17日
报告期末基金份额总额	368,234,276.21份
投资目标	在严格控制风险的前提下,投资于优质上市公司,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	本基金的投资策略包括大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、中小企业私募债投资策略、权证投资策略、金融衍生品投资策略等策略。
业绩比较基准	中证800指数收益率×50%+中国综合(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	-2,262,971.27
2.本期利润	-13,364,688.20
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0341
4.期末基金资产净值	363,921,288.76
5.期末基金份额净值	0.961

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。

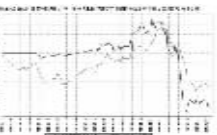
2.本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

#### 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	-3.00%	0.64%	-0.27%	0.39%	-3.53%	0.25%

##### 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(或基金经理小组)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
何文翔	融通新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2016年09月17日 -	8	何文翔先生,厦门大学金融学博士,曾任融通基金管理有限公司,历任融通基金研究员、专户投资经理,2014年10月加入融通基金,2015年11月担任“融通新趋势灵活配置混合型证券投资基金”基金经理,2016年9月17日起至今任“融通新趋势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》等有关法律法规和基金合同的约定,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

本基金在严格控制风险的前提下,投资于优质上市公司,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。本基金采用灵活配置的股票投资策略,主要采用量化投资策略投资于事件驱动、多因子策略,及其他多种量化策略,并基于风险优化模型构建股票投资组合,以提升投资策略的多元性和稳健性,力争获取超额收益。

#### 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-3.80%,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

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: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。

基金托管人中国农业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先仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期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	融通新区域新经济灵活配置混合
交易代码	001162
融通交易代码	001162
融通交易简称	001162
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年05月20日
报告期末基金份额总额	2,088,858,446.05份
投资目标	本基金按照“区域优势”和“战略性新兴产业”两条投资主线精选符合政策优势上上市公司,分享中国区域经济增长和新兴产业发展机遇,谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金的大类资产配置策略主要是通过宏观经济周期运行规律的研究,基于定量与定性相结合的分析,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,构建系统投资组合。本基金对宏观经济运行的跟踪为:分析宏观经济政策及市场预期,判断宏观经济走势,把握经济周期运行规律,确定资产配置策略,资产配置策略包括:股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的配置比例,并根据市场变化及时调整资产配置比例。
业绩比较基准	中国沪深300指数收益率×60%+中国综合(全价)指数收益率×40%
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(2016年10月1日 - 2016年12月31日)
1.本期已实现收益	-58,461,164.80
2.本期利润	-69,404,154.89
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0326
4.期末基金资产净值	1,099,002,070.65
5.期末基金份额净值	0.526

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。

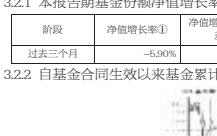
2.本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

#### 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	-5.00%	1.22%	-2.14%	0.41%	-3.76%	0.81%

##### 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



序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	262,626,517.52	79.64
2	其中:股票	262,626,517.52	79.64
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	72,002,550.36	20.43
11	其他资产	114,070.31	0.03
12	合计	365,342,147.19	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	467,322.00	0.13
B	采矿业	10,359,304.52	2.93
C	制造业	166,394,677.86	47.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,490,193.84	5.79
E	建筑业	2,303,292.23	0.65
F	批发和零售业	13,963,560.00	3.96
G	交通运输、仓储和邮政业	7,940,692.66	2.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,969,712.10	6.77
J	金融业	273,168.00	0.08
K	房地产业	21,256,077.44	6.02
L	租赁和商务服务业	2,156,680.00	0.61
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,114,341.72	1.16
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	8,898,490.03	2.51
S	综合	-	-
合计		262,626,517.52	79.64

### 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	000438	江苏神通	265,198	4,135,250.20	1.18
2	000968	南方能源	298,480	4,132,320.00	1.17
3	300100	斯迪克	285,708	4,114,241.72	1.16
4	000977	网宿科技	192,354	4,077,390.80	1.15
5	000246	赛微电子	446,723	4,061,777.81	1.14
6	002034	华创云信	446,400	4,048,488.00	1.14
7	300157	恒参医药	440,448	4,047,340.52	1.14
8	002240	大洋电机	450,397	3,964,586.11	1.12
9	300387	飞翔鸟	331,008	3,949,756.20	1.12
10	000527	顺络电子	292,338	3,938,258.36	1.11

### 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  
本基金本报告期末未投资国债期货。

### 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,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	项目	金额(元)
1	存出保证金	91,200.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	22,969.46
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	114,070.31

### 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

报告期末基金份额总额	434,453,196.12
报告期间基金总申购份额	1,136,164.64
减:报告期间基金总赎回份额	47,334,086.56
报告期间基金总申购份额(扣除赎回费以“减列”)	-
报告期间基金总赎回份额(扣除赎回费以“减列”)	-
报告期末基金份额总额	368,234,276.21

### § 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

- 备查文件目录
- (一)中国证监会批准融通新趋势灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- (二)《融通新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (三)《融通新趋势灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (四)《融通新趋势灵活配置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内免费查阅,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  
2017年1月20日

# 融通新能源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:中国建设银行股份有限公司  
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。

基金托管人中国建设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先仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期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	融通新能源灵活配置混合
交易代码	001471
融通交易代码	001471
融通交易简称	001471
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年09月29日
报告期末基金份额总额	1,259,476,081.15份
投资目标	通过挖掘新能源产业未来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	本基金的大类资产配置策略主要是通过宏观经济周期运行规律的研究,基于定量与定性相结合的分析及市场分析,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,构建系统投资组合。
业绩比较基准	中证内地新能源主题指数收益率×50%+中国综合(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(2016年10月1日 - 2016年12月31日)
1.本期已实现收益	90,874,580.12
2.本期利润	62,476,003.31
3.加权平均基金份额本期利润	0.0460
4.期末基金资产净值	1,347,286,379.23
5.期末基金份额净值	1.068

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。

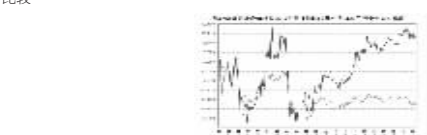
2.本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

#### 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	3.89%	0.66%	-1.27%	0.38%	5.16%	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



### §