

融通新趋势灵活配置混合型证券投资基金

2016年度报告摘要

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
送出日期:2017年3月30日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本基金报告期内已将三分之一之二以上独立董事签字并同意，并由董事长签发。

证券投资基金，大数超过10月~11月两个月的持续反反复复，12月初至今出现了一定调整，主要对内因估值包括货币类品种，制造业和货需求回暖，叠加回购贷款的后效效应，因此预计17年一季度各领域经济指标将持续企稳。全年来看，严控泡沫的资产投资将会上升，期待改革持续推进，带来改革红利和结构性改善。

本基金管理人中工行银行股份有限公司根据融通新趋势灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同规定，于2016年3月24日复核了本报告书的财务指标、净值表现、利差分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告书所载数据截至报告期末，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告书所载的数据经审计，未经基金托管人复核，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告书自基金经理签署之日起，至2016年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	融通新趋势灵活配置混合型证券投资基金
基金代码	000664
前端费用代码	000666
后端费用代码	000666
基金合同生效方式	定期开放
基金合同生效日	2016年6月1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
报告期基金总份额单位	360,234,206.21份
基金合同到期日	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标 在严格控制风险的前提下，力争实现资产的长期稳定增值。

投资策略 本基金的投资策略是通过资产配置，投资于股票、债券等金融工具，以期在控制风险的前提下，实现资产的长期稳定增值。

业绩比较基准 沪深300指数收益率×60%+中债综合全价(总值)指数收益率×40%

风险收益特征 本基金为混合型基金，预期风险及预期收益水平高于债券型基金，低于股票型基金，属中高风险、中高收益的基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	融通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
姓名	徐东	郭明
信息披露负责人	赵颖电话	(010)1605105999
电子邮箱	aoe@fundit.com	coanty@icbc.com.cn
客户服务电话	400-885-0088, (0765) 96688	
传真	(0765) 26906006	(010)16052981

2.4 信息披露方式

登载基金年报信息的管理人互联网网址

http://www.wittfund.com

基金年度报告备查地点

基金管理人处

5.3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 本期数据和指标	2016年10月1日至基金合同生效日(2016年12月31日)
本期利润	-1,000,000.00
本期利润总额	-13,731,601.00
归属于基金份额持有人的本期利润总额	-300%
3.1.2 利润数据和指标	2016年末
本期末的基金资产净值	-303,921,206.76
本期末基金份额净值	0.961
本期末基金份额总额	360,234,206.21

注:1.本基金基金合同不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计算费用时实际收取资金平率以扣除非费用后的金额为准。

2.本期利润为本期已实现收益减去本期公允价值变动收益,扣除非费用后的金额。

3.期末可供分配基金份额总额=期末基金总资产-期末资产总负债。

4.本期未分配利润=期末可供分配利润-期末未分配利润。

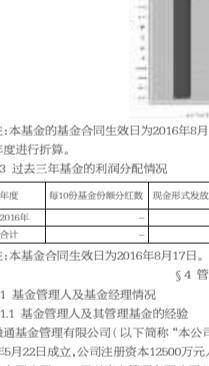
5.本基金合同生效日为2016年8月17日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额增长	长期平均	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去三个月	-3.80%	0.64%	-0.2%	0.3%	-3.5%
自基金合同生效日起至报告期期末	-3.80%	0.53%	-2.2%	0.3%	-1.6%
最近一年	-3.80%	0.53%	-2.2%	0.3%	0.17%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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.本基金基金合同生效日为2016年8月17日,合同生效当年按实际存续期间,未按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

3.3.1 基金份额持有人收益分配

3.3.2 基金利润分配情况

3.3.3 基金利润分配方案

3.3.4 基金利润分配政策

3.3.5 基金利润分配实施情况

3.3.6 基金利润分配实施情况

3.3.7 基金利润分配实施情况

3.3.8 基金利润分配实施情况

3.3.9 基金利润分配实施情况

3.3.10 基金利润分配实施情况

3.3.11 基金利润分配实施情况

3.3.12 基金利润分配实施情况

3.3.13 基金利润分配实施情况

3.3.14 基金利润分配实施情况

3.3.15 基金利润分配实施情况

3.3.16 基金利润分配实施情况

3.3.17 基金利润分配实施情况

3.3.18 基金利润分配实施情况

3.3.19 基金利润分配实施情况

3.3.20 基金利润分配实施情况

3.3.21 基金利润分配实施情况

3.3.22 基金利润分配实施情况

3.3.23 基金利润分配实施情况

3.3.24 基金利润分配实施情况

3.3.25 基金利润分配实施情况

3.3.26 基金利润分配实施情况

3.3.27 基金利润分配实施情况

3.3.28 基金利润分配实施情况

3.3.29 基金利润分配实施情况

3.3.30 基金利润分配实施情况

3.3.31 基金利润分配实施情况

3.3.32 基金利润分配实施情况

3.3.33 基金利润分配实施情况

3.3.34 基金利润分配实施情况

3.3.35 基金利润分配实施情况

3.3.36 基金利润分配实施情况

3.3.37 基金利润分配实施情况

3.3.38 基金利润分配实施情况

3.3.39 基金利润分配实施情况

3.3.40 基金利润分配实施情况

3.3.41 基金利润分配实施情况

3.3.42 基金利润分配实施情况

3.3.43 基金利润分配实施情况

3.3.44 基金利润分配实施情况

3.3.45 基金利润分配实施情况

3.3.46 基金利润分配实施情况

3.3.47 基金利润分配实施情况

3.3.48 基金利润分配实施情况

3.3.49 基金利润分配实施情况

3.3.50 基金利润分配实施情况

3.3.51 基金利润分配实施情况

3.3.52 基金利润分配实施情况

3.3.53 基金利润分配实施情况

3.3.54 基金利润分配实施情况

3.3.55 基金利润分配实施情况

3.3.56 基金利润分配实施情况

3.3.57 基金利润分配实施情况

3.3.58 基金利润分配实施情况

3.3.59 基金利润分配实施情况

3.3.60 基金利润分配实施情况

3.3.61 基金利润分配实施情况

3.3.62 基金利润分配实施情况

3.3.63 基金利润分配实施情况

3.3.64 基金利润分配实施情况

3.3.65 基金利润分配实施情况

3.3.66 基金利润分配实施情况

3.3.67 基金利润分配实施情况

3.3.68 基金利润分配实施情况

3.3.69 基金利润分配实施情况

3.3.70 基金利润分配实施情况