

融通新能源灵活配置混合型证券投资基金

[2017] 第一季度报告

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：2017年4月21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4月17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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至2017年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

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	36,908,200.00	3.00
C	制造业	382,638,677.28	31.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,909,432.60	0.41
F	批发和零售业	243,263,122.34	19.83
G	交通运输、仓储和邮政业	131,314.89	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	82,501,950.00	6.72
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	13,358,500.00	1.13
M	科学研究和技术服务业	14,400,856.08	1.17
N	水利、环境和公共设施管理业	62,338,468.82	4.26
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	39,039,726.72	3.18
S	综合	-	-
合计		870,268,248.63	70.92

本基金的资产配置策略主要是通过对宏观经济运行规律的研究，基于对行业性和结构性的投资分析及对市场的判断，结合货币市场工具及其他金融工具的比例，进行资产配置。

业绩比较基准 中国新能新能源指数收益率×50%+恒生综合(全价)指数收益率×50%

风险收益特征 风险收益特征为股票型基金与货币市场基金，低于股票基金，高于货币市场基金，属于股票型基金与货币市场基金的中间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

3.1 主要财务指标 单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)

1.本期已实现收益 46,769,060.15

2.本期利润 36,305,466.20

3.期末可供基金份额总额 63,000.00

4.期末基金资产净值 1,227,170,786.02

5.期末基金份额净值 1.194

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.本报告期揭示的本基金业绩指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用，计人费用后实际收益水平将发生变动。

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(①) 净值增长标准差(②) 业绩比较基准收益率(③) 业绩比较基准收益率差(④)
过去三个月 2.65% 0.73% 1.83% 0.33% 0.72% 0.40%

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

图表显示：基金成立以来，净值呈现波动上升趋势，截至2017年3月31日，净值为1.194，相较于基金合同生效日（2016年8月17日）的1.000，增长约19.4%。

3.4 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 说明

付伟峰 基金经理、研究总监助理 2016年6月20日 - 6 付伟峰先生，清华大学理学博士，清华大学电子工程系硕士，现就职于融通基金管理有限公司，具有基金从业资格，担任融通基金管理有限公司基金经理，2014年11月加入融通基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理、融通深证成长30指数分级基金经理、融通基金基金经理。

注：任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写；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的情况的说明

报告期内，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本基金，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 平等交易原则的执行情况

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、交易和业绩评价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

2017年一季报，股市分化较大，上证综指涨3.83%，深证成指涨2.47%，创业板下跌指数2.79%。融通新能源一度处在待申购状态，上季度涨幅为-1%，十大重仓中降低了有色金属股票配置，同时进一步向成长股集中。从本季度末的持仓情况来看，除了有色金属类股票外，其余全部是内生增长强劲的成长股。

我们认为，宏观经济经过一年时间的回升，目前已经处于较强的状态，并且预计宏观未来一段时间仍会较为稳定，但由于周期股的市盈率相对平稳，主要是因为在宏观经济持续强劲的概率较低，产品价格和量增速度以持续放缓，且动态估值相对不变。

我们认为，在宏观经济稳定的背景下，优质成长股是未来一段时间内最佳投资方向。从行业偏好上，我们看好新能源汽车产业链、环保、电商、电力改革等方向。

4.5 报告期内基金的绩效表现

本基金报告期内基金份额净值增长率为2.55%，同期业绩比较基准收益率为1.83%。

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	870,268,248.63	69.09
其中：股票		870,268,248.63	69.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
其中：债券		-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	367,524,754.23	29.06
8	其他资产	6,713,699.97	0.46
9	合计	1,243,506,662.63	100.00

5.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金报告期末未持有股票。

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 002640 跨境通 7,260,000 121,656,000.00 9.91

2 300305 恒泰艾普 2,200,052 82,501,960.00 6.72

3 601033 永辉超市 14,716,700 80,941,890.00 6.60

4 002311 东诚药业 4,000,000 66,120,000.00 5.29

5 600114 东方园林 3,404,708 62,904,744.00 5.13

6 300203 宝利得 4,856,894 48,856,894.00 4.38

7 000588 高能环境 1,400,030 42,658,914.10 3.48

8 300144 宋城演艺 1,999,998 39,039,726.72 3.18

9 601899 紫金矿业 10,800,000 36,808,200.00 3.00

10 000630 丽珠集团 11,000,000 34,970,000.00 2.94

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金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权证及金融衍生品投资明细

本基金报告期末未持有权证及金融衍生品。

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十名股票投资明细

本基金报告期末未持有股票。

5.9 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债券投资明细

本基金报告期末未持有债券。

5.10 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

本基金报告期末未持有资产支持证券。

5.11 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权证及金融衍生品投资明细

本基金报告期末未持有权证及金融衍生品。

5.12 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

本基金报告期末未持有股票。

5.13 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债券投资明细

本基金报告期末未持有债券。

5.14 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

本基金报告期末未持有资产支持证券。

5.15 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权证及金融衍生品投资明细

本基金报告期末未持有权证及金融衍生品。

5.16 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

本基金报告期末未持有股票。

5.17 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债券投资明细

本基金报告期末未持有债券。

5.18 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

本基金报告期末未持有资产支持证券。

5.19 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权证及金融衍生品投资明细

本基金报告期末未持有权证及金融衍生品。

5.20 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

本基金报告期末未持有股票。

5.21 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金报告期末未持有股票。

5.22 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债券投资组合

本基金报告期末未持有债券。