融通现金宝货币市场基金

【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:包商银行股份有限公司
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。

基金托管人包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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通现金宝货币	
交易代码	002788	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年11月10日	
报告期末基金份额总额	1,121,777,666.29份	
投资目标	在严格控制基金资产投资风险和保持基金资产较高流动性的基础上,力争获得超越业绩比较基准的稳定回报。	
投资策略	根据对未来短期利率变动的预测,确定和调整基金投资组合的平均剩余期限。对各类投资品种进行定性分析和定量分析,确定和调整各与的投资品种和各类投资品种的配置比例。在严格控制投资风险和保持资产流动性的基础上,力争获得稳定的当期收益。	
业绩比较基准	银行活期存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种,其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
基金托管人	包商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	融通现金宝货币A	融通现金宝货币B
下属分级基金的交易代码	002788	004398
报告期末下属分级基金的份额总额	119,405,814.12份	1,002,371,852.17份

注:根据《关于融通现金宝货币市场基金增设B类基金份额并修订基金合同部分条款的公告》,本基金于2017年2月24日实施基金份额分类,增设B类份额;

§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(2017年1月1日 - 2017年3月31日)	
	融通现金宝货币A	融通现金宝货币B
1. 本期已实现收益	1,088,137.80	2,483,958.04
2. 本期利润	1,088,137.80	2,483,958.04
3. 期末基金资产净值	119,405,814.12	1,002,371,852.17

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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

(2)融通现金宝货币B的数据统计期间为2017年3月9日至本报告期末止。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

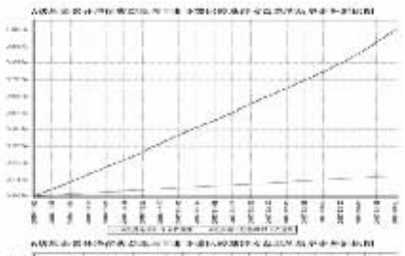
融通现金宝货币A

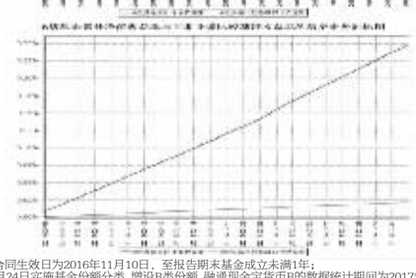
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7313%	0.0014%	0.0863%	0.0000%	0.6450%	0.0014%

融通现金宝货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.2484%	0.0011%	0.0221%	0.0000%	0.2263%	0.0011%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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11月10日,至报告期末基金成立未满1年;

2、自2017年2月24日实施基金份额分类,增设B类份额,融通现金宝货币B的数据统计期间为2017年3月9日至本报告期末;

3、本基金的建仓期为合同生效日起6个月。截至报告期末,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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王超	本基金的基金经理、固定收益部副总监	2016/11/10	-	9	王超先生,金融工程硕士,经济学、数学双学士,9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副总监。历任深圳发展银行(现更名为平安银行)债券自营交易盘投资与理财投资管理经理。2012年8月加入融通基金管理有限公司,现任融通可转债债券(由原融通标普中债可转债指数基金转型而来)、融通债券、融通四季添利债券(LOF)、融通岁岁添利定期开放债券、融通增鑫债券、融通增益债券、融通增裕债券、融通通泰保本、融通理丰债券、融通现金宝货币、融通稳利债券基金的基金经理。

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工作的时间为计算标准。

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

一季度1月份资金面略有改善,但好景不长,央行在释放大量资金应对春节现金需求后意外的上调了MLF利率,并在春节后第一个工作日上调了公开市场逆回购利率,表明了紧缩的态度。随后一季度MPA考核,叠加光大转债的发行,导致资金面骤然紧张,存单利率大幅上调。投资方面,本基金在一季度跟随市场变化调整了组合久期和杠杆水平。

展望二季度,预计货币市场资金面仍然不乐观。投资者普遍预期在季末的考核过后,资金面将迎来喘息之机。但通过央行在公开市场的表现来看,4月份将依然面临资金面紧张的局面。因为央行已经连续多日停止公开市场操作,净回笼资金近4000亿,而4.5月份将迎来缴税及财政性存款上缴,资金面届时将仍会受到冲击,目前转债发行节奏加快,也对资金面形成干扰。二季度投资上将着重把握货币市场紧张时点同业存单和高等级短融的配置机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,融通现金宝货币A类份额净值收益率为0.7313%,融通现金宝货币B类份额净值收益率为0.2484%,融通现金宝货币A类同期业绩比较基准收益率为0.0863%,融通现金宝货币B类同期业绩比较基准收益率为0.0221%。

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	固定收益投资	724,190,221.22	56.47
	其中:债券	724,190,221.22	56.47
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	555,843,370.32	43.34
4	其他资产	2,370,641.63	0.18
5	合计	1,282,404,233.17	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	2.51	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	160,151,279.77	14.28
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	84
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	90
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	9

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	2.30	14.28
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	21.29	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	65.66	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	17.83	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	7.03	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		114.11	14.28

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

报告期内投资组合平均剩余存续期未出现超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	48,749,560.54	4.35
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,136,715.39	5.36
	其中:政策性金融债	60,136,715.39	5.36
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	615,303,945.29	54.85
8	其他	-	-
9	合计	724,190,221.22	64.56
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111710117	17兴业银行CD117	1,800,000	178,517,507.33	15.91
2	111709056	17浦发银行CD056	1,500,000	149,096,798.61	13.29
3	111707065	17招商银行CD065	500,000	49,699,012.36	4.43
4	111709109	17浦发银行CD109	500,000	49,506,677.40	4.41
5	111794213	17上海农商银行CD086	400,000	39,605,307.09	3.53
6	019557	17国债03	388,000	38,774,386.47	3.46
7	140378	14进出78	300,000	30,024,195.04	2.68
8	111794216	17张家口银行CD013	300,000	29,700,766.82	2.65
9	111794224	17锦州银行CD070	300,000	29,700,766.82	2.65
10	150224	15国开24	200,000	20,092,201.40	1.79
	111720032	17广发银行CD032	200,000	19,979,155.57	1.78

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0002%
报告期内偏离度的最低值	-0.0352%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0103%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期未出现偏离度绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期未出现偏离度绝对值达到0.50%的情况。

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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 本基金采用摊余成本法计价,固计价对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价和折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

5.9.2 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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	2,070,451.77
4	应收申购款	300,189.86
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,370,641.63

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	融通现金宝货币A	融通现金宝货币B
报告期期初基金份额总额	187,600,744.18	-
报告期期间基金总申购份额	33,398,094.57	1,002,371,852.17
报告期期间基金总赎回份额	101,593,024.63	-
报告期末基金份额总额	119,405,814.12	1,002,371,852.17

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况							
投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017-3-9-2017-3-31	-	1,002,371,852.17	-	1,002,371,852.17	89.36%
	2	2017-1-1-2017-3-8	147,126,045.24	31,064,774.83	60,061,302.19	118,129,517.88	10.53%
个人		-	-	-	-	-	-
		-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时,可能存在因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金单位份额净值剧烈波动的风险及流动性风险。							

8.2影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人自2017年2月24日起对本基金增设B类基金份额(基金简称:融通现金宝货币B;基金代码:004398),原基金份额转为A类基金份额(基金简称:融通现金宝货币A;基金代码:002788)。该事项经与基金托管人包商银行股份有限公司协商一致,并报中国证监会备案,基金管理人对原《基金合同》中的相关内容进行相应修改,并同步修改《融通现金宝货币市场基金托管协议》。具体内容请参阅2017年2月24日刊登在指定信息披露媒体上刊登的《关于融通现金宝货币市场基金增设B类基金份额并修订基金合同部分条款的公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准融通现金宝货币市场基金设立的文件

(二)《融通现金宝货币市场基金合同》

(三)《融通现金宝货币市场基金托管协议》

(四)《融通现金宝货币市场基金招募说明书》

(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

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

9.3 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http://www.rtfund.com查询。

融通基金管理有限公司
2017年4月21日

融通新机遇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04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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年01月01日起至2017年03月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通新机遇灵活配置混合
交易代码	002049
前端交易代码	002049
后端交易代码	002050
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年11月17日
报告期末基金份额总额	1,259,382,156.96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	在经济周期各阶段,综合对所跟踪的宏观经济指标和市场指标的分析,本基金对大类资产进行配置的策略为:在经济的复苏和繁荣期超配股票资产;在经济的衰退和政策刺激阶段,超配债券等固定收益类资产,力争通过资产配置获得部分超额收益。
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(2017年1月1日 - 2017年3月31日)
1.本期已实现收益	12,877,464.57
2.本期利润	10,584,759.90
3.加权平均基金份额本期利润	0.0084
4.期末基金资产净值	1,271,714,703.65
5.期末基金份额净值	1.010

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。

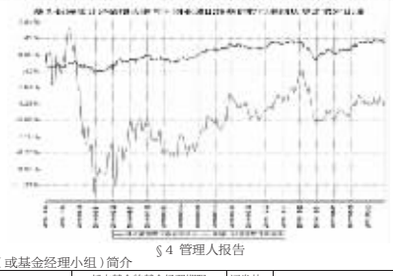
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	0.90%	0.11%	1.56%	0.27%	-0.66%	-0.16%

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		
张一格	本基金的基金经理、固定收益部总经理。	2016年9月22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等基金的基金经理。2015年6月加入融通基金管理有限公司。现任融通易支付货币、融通通盈保本混合、融通腾裕债券、融通增锌债券、融通增丰债券、融通通瑞债券、融通通优债券、融通月月添利定期开放债券、融通通景灵活配置混合、融通通鑫灵活配置混合、融通新机遇灵活配置混合、融通通裕债券基金的基金经理。
余志勇	本基金的基金经理,研究部副总监。	2015年11月17日	-	16	余志勇先生,武汉大学金融学硕士、工商管理学学士,16年证券投资从业经历,具有证券从业资格,现任融通基金管理有限公司研究部副总监。历任湖北省农业厅研究员,国发证券公司研究员,招商证券股份有限公司研究发展中心研究员。2007年4月加入融通基金管理有限公司,历任研究部行业研究员、行业组长,现任融通通泽灵活配置混合、融通通泰保本、融通通鑫灵活配置混合、融通新机遇灵活配置混合、融通增裕债券、融通增丰债券、融通通景灵活配置混合、融通通尚灵活配置混合、融通四季添利债券(LOF)、融通新优选灵活配置混合、融通通润债券基金的基金经理。

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工作的时间为计算标准。

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。

4.5 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0.90%,同期业绩比较基准收益率为1.56%。

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	124,468,083.76	9.77
	其中:股票	124,468,083.76	9.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,111,855,838.84	87.31
	其中:债券	1,111,855,838.84	87.31
	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	15,000,000.00	1.18
	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	6,040,550.70	0.47
8	其他资产	16,072,869.26	1.26
9	合计	1,273,437,342.56	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	57,735,784.10	4.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	15,903,370.92	1.25
F	批发和零售业	74,088.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	7,001,314.89	0.55
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,287,559.41	0.89
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	9,368,623.90	0.74
M	科学研究和技术服务业	5,511,702.72	0.43
N	水利、环境和公共设施管理业	17,585,639.82	1.38
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	124,468,083.76	9.79

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	002008	大族激光	500,000	13,135,000.00	1.03
2	603609	禾丰牧业	800,000	9,632,000.00	0.76
3	600054	黄山旅游	490,000	8,477,000.00	0.67
4	002570	贝因美	550,000	7,133,500.00	0.56
5	600115	东方航空	1,000,000	6,870,000.00	0.54
6	603588	高能环境	203,106	6,188,639.82	0.49
7	300059	东方财富	400,000	5,992,000.00	0.47
8	600068	葛洲坝	500,000	5,885,000.00	0.46
9	600528	中铁工业	350,000	5,631,500.00	0.44
10	300284	苏交科	299,933	5,494,772.56	0.43

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	229,058,000.00	18.01
	其中:政策性金融债	229,058,000.00	18.01
4	企业债券	161,499,675.60	12.70
5	企业短期融资券	523,354,400.00	41.15
6	中期票据	190,731,200.00	15.00
7	可转债(可交换债)	7,212,563.24	0.57
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,111,855,838.84	87.43

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	101652003	16南电MTN001	1,100,000	107,624,000.00	8.46
2	150409	15农发09	1,000,000	100,250,000.00	7.88
3	011698185	16沪电力SCP006	1,000,000	100,200,000.00	7.88
4	160414	16农发14	700,000	69,958,000.00	5.50
5	011698773	16陕煤化SCP010	600,000	59,814,000.00	4.70

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本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	65,440.27
2	应收证券清算款	521,603.62
3	应收股利	-
4	应收利息	15,485,825.37
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,072,869.26

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的说明

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,259,376,337.99
报告期期间基金总申购份额	10,039.08
减:报告期期间基金总赎回份额	4,220.11
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,259,382,156.96

§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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017-1-1-2017-3-31	1,259,251,515.15	-	-	1,259,251,515.15	99.99%
个人		-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时,可能存在因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金单位份额净值剧烈波动的风险及流动性风险。							

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

(二)《融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

(三)《融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(四)《融通新机遇灵活配置混合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

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

9.3 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4月21日

融通新蓝筹证券投资基金

【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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通新蓝筹混合
交易代码	161601
前端交易代码	161601
后端交易代码	161602
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年9月13日
报告期末基金份额总额	2,970,131,156.66份
投资目标	主要投资于处于成长阶段和成熟阶段早期的"新蓝筹"上市公司。通过组合投资,在充分控制风险的前提下实现基金净值的稳定增长,为基金持有人获取长期稳定的投资收益。
投资策略	在对市场趋势判断的前提下,重视仓位选择和行业配置,同时更重视基本面分析,强调通过基本面分析挖掘个股。在正常市场状况下,股票投资比例浮动范围:30%-75%;债券投资比例浮动范围:20%-55%;权证投资比例浮动范围:0%-3%;现金留存比例浮动范围:不低于5%。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+中债综合全价(总值)指数收益率×25%
风险收益特征	在适度风险下追求较高收益
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(2017年1月1日 - 2017年3月31日)
1.本期已实现收益	-64,748,112.46
2.本期利润	41,648,697.27
3.加权平均基金份额本期利润	0.0139
4.期末基金资产净值	2,404,584,023.05
5.期末基金份额净值	0.8096

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;

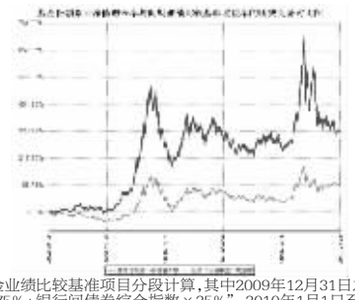
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	1.73%	0.52%	2.98%	0.39%	-1.25%	0.13%

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:上图中基金业绩比较基准项目分段计算,其中2009年12月31日之前(含此日)采用"国泰君安指数×75%+银行间债券综合指数×25%",2010年1月1日至2015年9月30日期间采用"沪深300指数收益率×75%+中信标普全债指数收益率×25%",2015年10月1日起使用新基准即"沪深300指数收益率×75%+中债综合全价(总值)指数收益率×25%"。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)