融通成长30灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年9月30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10月26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10月23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7月1日起至2017年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通成长30灵活配置混合
交易代码	002252
前端交易代码	002252
后端交易代码	002253
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年12月11日
报告期末基金份额总额	302,666,124.46份
投资目标	本基金通过精选个股和集中投资,在科学严格管理风险的前提下,谋求基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金的资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究,基于定量与定性相结合的宏观及市场分析,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,规避系统性风险。
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(2017年7月1日-2017年9月30日)
1.本期已实现收益	2,278,685.07
2.本期利润	11,823,567.21
3.加权平均基金份额本期利润	0.0332
4.期末基金资产净值	318,052,240.15
5.期末基金份额净值	1.051

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。

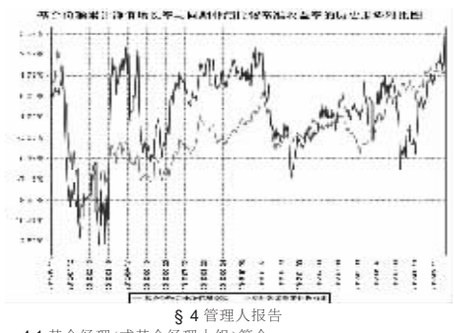
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	4.27%	0.86%	2.24%	0.29%	2.03%	0.57%

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		
付伟琦	本基金的基金经理、研究部总经理	2017年2月18日	-	7	付伟琦先生,清华大学物理学博士、西安交通大学物理学学士,7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研究部总经理。历任中信证券公司行业研究员、瑞银证券公司行业研究员。2014年11月加入融通基金管理有限公司,现任融通新能源灵活配置混合、融通内需驱动混合、融通成长30灵活配置混合基金的基金经理。

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

本基金管理人三一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

三季度上证综指涨4.90%,深圳成指上涨5.3%,创业板上涨2.69%,中小板指上涨8.86%,整体处于上涨状态。从结构上看,周期板块表现最为突出。

本基金三季度整体投资方向依然是内生增长速度快的个股,整体仓位上我们依然保持中等水平。我们认为,中国宏观经济将保持在较为稳定的状态,自下而上挖掘高成长个股是较为有效的策略,我们的投资也依然会集中于这个方向。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.051元;本报告期基金份额净值增长率为4.27%,业绩比较基准收益率为2.24%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§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	258,360,271.09	77.97
	其中:股票	258,360,271.09	77.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	-	-
	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	72,677,906.48	21.93
8	其他资产	305,347.55	0.09
9	合计	331,343,525.12	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	6,588,250.00	2.07
B	采矿业	39,793.60	0.01
C	制造业	122,564,995.07	38.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,088,125.44	1.29
E	建筑业	24.72	0.00
F	批发和零售业	34,207,622.64	10.76
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	37,184,600.92	11.69
J	金融业	12,924,626.00	4.06
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	19,289,702.00	6.06
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,371,065.91	1.37
R	文化、体育和娱乐业	17,075,892.88	5.37
S	综合	-	-
	合计	258,360,271.09	81.23

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	1,468,827	34,179,604.29	10.75
2	603556	海兴电力	742,965	31,234,248.60	9.82
3	300365	恒华科技	765,773	28,693,514.31	9.02
4	300144	宋城演艺	909,790	17,031,268.80	5.35
5	600114	东睦股份	923,977	16,400,591.75	5.16
6	002127	南极电商	911,200	14,314,952.00	4.50
7	300115	长盈精密	377,800	13,060,546.00	4.11
8	300408	三环集团	528,200	12,988,438.00	4.08
9	603737	三棵树	195,116	12,863,997.88	4.04
10	300418	昆仑万维	320,500	8,470,815.00	2.66

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

本基金本报告期未持有股指期货。

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

本基金本报告期未持有国债期货。

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

本基金本报告期末持有国债期货。

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,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	290,255.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,697.32
5	应收申购款	394.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	305,347.55

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

单位:份

报告期期初基金份额总额	426,068,289.58
报告期期间基金总申购份额	196,448.58
减:报告期期间基金总赎回份额	123,598,613.70
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期末基金份额总额	302,666,124.46

§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

8.1 备查文件目录

(一)《融通成长30灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

(二)《融通成长30灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(三)《融通成长30灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新

(四)中国证监会批准融通成长30灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

(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、基金托管人处。

8.3 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10月26日

融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)

2017年第三季度报告

2017年9月30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10月26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10月23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7月1日起至2017年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通巨潮100指数(LOF)	
场内简称	融通巨潮	
交易代码	161607	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2005年5月12日	
报告期末基金份额总额	700,565,365.66份	
投资目标	本基金为增强型指数基金。在控制股票投资组合相对巨潮100目标指数跟踪误差的基础上,力求获得超越巨潮100目标指数的投资收益,追求长期的资本增值。本基金谋求分享中国经济的持续、稳定增长和中国证券市场发展的成果,实现基金财产的长期增长,为投资者带来稳定的回报。	
投资策略	本基金为增强型指数基金,在控制股票投资组合相对目标指数偏离风险的基础上,力争获得超越目标指数的投资收益。基金以指数化分散投资为主要投资策略,在此基础上进行适度的主动调整,在数量化投资技术与基本面深入研究的结合中谋求基金投资组合在偏离风险及超额收益间的最佳匹配。为控制基金偏离目标指数的风险,本基金力求将基金份额净值增长率与目标指数增长率间的日跟踪误差控制0.5%。	
业绩比较基准	巨潮100指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%	
风险收益特征	风险和预期收益率接近市场平均水平	
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	
下属分级基金的基金简称	融通巨潮100指数A/B	融通巨潮100指数C
下属分级基金的交易代码	161607	004874
下属分级基金的前端交易代码	161607	004874
下属分级基金的后端交易代码	161657	-
报告期末下属分级基金的份额总额	700,563,815.34份	1,550.32份

注:2017年7月5日起,本基金管理人发布了《关于融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)增设C类基金份额并修订基金合同部分条款的公告》,于2017年7月5日对融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)增设C类基金份额(基金简称:融通巨潮100指数C,基金代码:004874),同时根据新法律法规对《基金合同》和《托管协议》进行了相应修改。

§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7月1日-2017年9月30日)	报告期(2017年7月5日-2017年9月30日)
	融通巨潮100指数A/B	融通巨潮100指数C
1. 本期已实现收益	48,473,503.68	59.02
2. 本期利润	54,883,953.77	94.47
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0724	0.0797
4. 期末基金资产净值	844,194,266.20	1,867.64
5. 期末基金份额净值	1.205	1.205

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)本基金于2017年7月5日增设了C类份额,该类份额的统计期间为2017年7月6日至本报告期末。

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

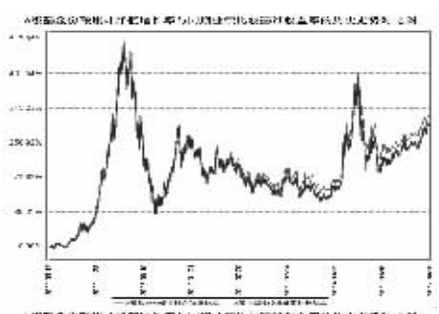
融通巨潮100指数A/B

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	6.35%	0.65%	4.80%	0.59%	1.55%	0.06%

融通巨潮100指数C

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	6.26%	0.64%	5.16%	0.57%	1.10%	0.07%

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:本基金于2017年7月5日增设了C类份额,该类份额的统计期间为2017年7月6日至本报告期末。

§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		
蔡志伟	本基金的基金经理	2015年2月11日	-	6	蔡志伟先生,华南师范大学计算机硕士、广州大学计算机学士,金融风险管理师(FRM),6年证券投资从业经历,具有基金从业资格。曾就职于汇丰软件开发广东有限公司任高级软件工程师(SSE)。2011年6月加入融通基金管理有限公司,历任风险管理专员、金融工程研究员,现任融通巨潮100指数(LOF)、融通深证成份指数、融通创业板指数基金的基金经理。

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

在严格遵守基金合同的前提下实现持有人利益的最大化是本基金管理的核心思想,并将此原则贯彻于基金的运作之中。本基金运用指数化投资方式,采取量化策略进行指数增强和风险管理,在控制基金相对巨潮100指数基金基准的跟踪误差下,力求最终为投资者带来超越基金基准的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通巨潮100指数A/B基金份额净值为1.205元,本报告期基金份额净值增长率为6.35%;业绩比较基准收益率为4.80%;截至本报告期末融通巨潮100指数C基金份额净值为1.205元,本报告期基金份额净值增长率为6.26%;业绩比较基准收益率为5.16%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§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	799,876,738.19	94.34
	其中:股票	799,876,738.19	94.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	29,958,000.00	3.53
	其中:债券	29,958,000.00	3.53
	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	-	-
	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	16,869,619.05	1.99
8	其他资产	1,127,504.01	0.13
9	合计	847,831,861.25	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	17,485,971.30	2.07
C	制造业	217,988,732.22	25.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,669,951.04	0.67
E	建筑业	43,679,836.04	5.17
F	批发和零售业	5,842,600.00	0.69
G	交通运输、仓储和邮政业	6,295,345.00	0.75
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,637,464.62	2.68
J	金融业	410,828,580.49	48.67
K	房地产业	26,857,805.76	3.18
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	757,286,286.47	89.71

5.2.2 报告期末积极投资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	1,506,822.00	0.18
B	采掘业	11,667,497.70	1.38
C	制造业	20,659,565.62	2.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,306,533.44	0.15
E	建筑业	1,308,537.72	0.16
F	批发和零售业	26,385.45	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	1,349,379.91	0.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,621,296.03	0.31
J	金融业	1,767.36	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	655,326.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.01
R	文化、体育和娱乐业	1,372,040.50	0.16
S	综合	-	-
	合计	42,590,451.72	5.05

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

5.3.1 报告期末指数投资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	601318	中国平安	986,234	53,414,433.44	6.33
2	600036	招商银行	1,574,723	40,234,172.65	4.77
3	601166	兴业银行	2,183,231	37,748,063.99	4.47
4	000651	格力电器	907,674	34,400,844.60	4.07
5	601688	华泰证券	1,355,391	30,658,944.42	3.63
6	600519	贵州茅台	56,547	29,270,989.08	3.47
7	601288	农业银行	6,638,808	25,360,246.56	3.00
8	601668	中国建筑	2,482,763	23,040,040.64	2.73
9	600048	保利地产	2,209,208	22,975,763.20	2.72
10	600887	伊利股份	813,506	22,371,415.00	2.65

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	000983	西山煤电	902,610	9,305,909.10	1.10
2	002157	正邦科技	876,300	4,661,916.00	0.55
3	000876	新希望	309,300	2,279,541.00	0.27
4	002086	东方海洋	140,300	1,506,822.00	0.18
5	000571	新大洲A	203,200	1,473,200.00	0.17

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	29,958,000.00	3.55
	其中:政策性金融债	29,958,000.00	3.55
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	29,958,000.00	3.55

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	170401	17农发01	300,000	29,958,000.00	3.55

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

本基金本报告期未持有股指期货。

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

本基金本报告期未持有国债期货。

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

本基金本报告期末持有国债期货。

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期报告期内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、处罚的情形。

华泰证券:2016年11月28日,华泰证券收到中国证监会《行政处罚决定书》([2016]126号)。中国证监会根据当事人违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度,依据《证券公司监督管理条例》第八十四条的规定对华泰证券责令改正,给予警告,没收违法所得18,235,275.00元,并处以54,705,825.00元罚款。

本基金依照法律法规及基金合同的约定,采取指数化投资策略,紧密跟踪标的指数。

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	104,643.77
2	应收证券清算款	138,819.59
3	应收股利	-
4	应收利息	708,053.45
5	应收申购款	175,987.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,127,504.01

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

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	融通巨潮100指数A/B	融通巨潮100指数C
报告期期初基金份额总额	737,896,696.98	-
报告期期间基金总申购份额	95,111,828.61	2,005.79
减:报告期期间基金总赎回份额	132,444,710.25	455.47
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期末基金份额总额	700,563,815.34	1,550.32

注:本基金于2017年7月5日增设了C类份额。

§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

8.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)设立的文件

(二)《融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)基金合同》

(三)《融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)托管协议》

(四)《融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)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

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处、深圳证券交易所。

8.3 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10月26日

融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年9月30日

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10月26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10月24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7月1日起至2017年9月30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	001152
前端交易代码	001152
后端交易代码	001153
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月20日
报告期末基金份额总额	1,739,112,108.19份
投资目标	本基金按照"区域优势"和"战略性新兴产业"两条投资主线筛选符合条件的优质上市公司,分享中国区域经济增长和战略新兴产业发展中的投资机会,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的大类资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究,基于定量与定性相结合的宏观及市场分析,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,规避系统性风险。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阶段配股票资产;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	中证新兴产业指数收益率×50%+中债综合(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(2017年7月1日-2017年9月30日)
1.本期已实现收益	24,008,657.98
2.本期利润	40,843,689.31
3.加权平均基金份额本期利润	0.0224
4.期末基金资产净值	953,459,558.93
5.期末基金份额净值	0.548

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。

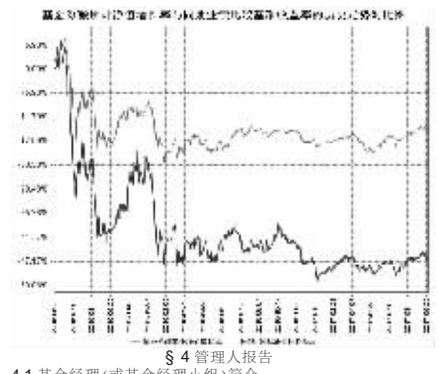
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	4.38%	0.81%	3.30%	0.42%	1.08%	0.39%

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		
杨博琳	本基金的基金经理	2015年5月20日	-	7	杨博琳先生,北京大学金融学硕士、上海交通大学船舶与海洋工程学士,7年证券投资从业经历,具有基金从业资格。历任华夏基金管理有限公司研究员、TMT研究组长。2014年12月加入融通基金管理有限公司,现任融通新区域新经济灵活配置混合基金的基金经理。

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。

4.3.3 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年三季度,上证综指上涨4.9%,创业板指上涨2.69%,中小板指上涨8.86%。从行业指数来看,煤炭、钢铁为代表的周期行业,白酒为代表的消费行业,以及新能源车