融通新机遇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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	1,059,371,676.53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7月1日－2017年9月30日）
1.本期已实现收益	13,090,415.67
2.本期利润	20,753,435.85
3.加权平均基金份额本期利润	0.0191
4.期末基金资产净值	1,085,636,646.25
5.期末基金份额净值	1.025

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。

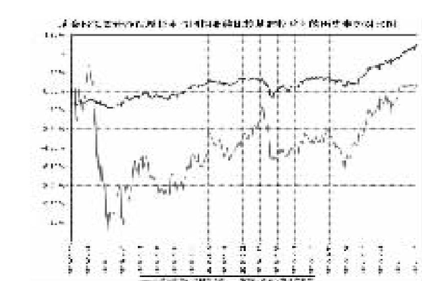
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	1.99%	0.12%	2.24%	0.29%	-0.25%	-0.17%

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、固定收益投资总监	2016年9月22日	-	11	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）。11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投资总监。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、融通增裕债券、融通增祥债券、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、融通收益增强债券基金的基金经理。
余志勇	本基金的基金经理、研究部总监	2015年11月17日	-	17	余志勇先生，武汉大学金融学硕士、工商管理学学士，17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总监。历任湖北省农业厅研究员、闽发证券公司研究员、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、融通尚灵活配置混合、融通四季添利债券（LOF）、融通通润债券、融通新动力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

本基金的投资目标是绝对收益，同时也为了保持基金净值增长率的平稳性，本基金保持了较低的仓位，并采取了组合投资和新股申购的投资策略。

未来一段时间我们认为市场特征依然会以震荡向上为主；传统经济面临去杠杆控风险过程，资本市场可能会出现阶段性的波动，但部分优秀公司的经营效率在供应侧改革因素驱动下逐步提升；新兴产业不断增长，消费产业稳定提升。本基金会采取相对均衡的组合投资策略，力求在行业配置和个股选择上，获取持续稳定的超额收益α。

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1.025元；本报告期基金份额净值增长率为1.99%，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	134,739,835.46	12.40
	其中：股票	134,739,835.46	12.40
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	848,313,461.66	78.05
	其中：债券	848,313,461.66	78.05
	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	90,350,451.78	8.31
	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	773,971.93	0.07
8	其他资产	12,726,712.75	1.17
9	合计	1,086,904,433.58	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	648,180.00	0.06
B	采矿业	7,899,115.60	0.73
C	制造业	87,946,102.16	8.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	6,508,293.45	0.60
G	交通运输、仓储和邮政业	1,495,523.91	0.14
H	住宿和餐饮业	715,920.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,727,958.28	0.53
J	金融业	8,030,870.65	0.74
K	房地产业	4,350,848.80	0.40
L	租赁和商务服务业	5,026,296.68	0.46
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,119,195.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,381,799.99	0.13
R	文化、体育和娱乐业	3,858,637.50	0.36
S	综合	-	-
	合计	134,739,835.46	12.41

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	600276	恒瑞医药	96,200	5,765,266.00	0.53
2	601888	中国国旅	145,732	5,026,296.68	0.46
3	600809	山西汾酒	90,105	4,960,280.25	0.46
4	600887	伊利股份	180,100	4,952,750.00	0.46
5	600801	华新水泥	322,800	4,658,004.00	0.43
6	600808	马钢股份	872,100	4,011,660.00	0.37
7	600036	招商银行	156,983	4,010,915.65	0.37
8	000983	西山煤电	352,400	3,633,244.00	0.33
9	300136	信维通信	85,900	3,607,800.00	0.33
10	002475	立讯精密	173,450	3,583,477.00	0.33

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	169,488,000.00	15.61
	其中：政策性金融债	169,488,000.00	15.61
4	企业债券	161,157,413.00	14.84
5	企业短期融资券	90,407,000.00	8.33
6	中期票据	190,848,000.00	17.58
7	可转债（可交换债）	1,564,048.66	0.14
8	同业存单	234,849,000.00	21.63
9	其他	-	-
10	合计	848,313,461.66	78.14

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	150409	15农发09	1,000,000	100,040,000.00	9.21
2	111710470	17兴业银行CD470	1,000,000	97,800,000.00	9.01
3	101652003	16南电MTN001	800,000	78,688,000.00	7.25
4	136177	16电气债	600,000	58,806,000.00	5.42
5	160406	16农发06	500,000	49,850,000.00	4.59

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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	33,629.45
2	应收证券清算款	242,051.93
3	应收股利	-
4	应收利息	12,451,031.37
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,726,712.75

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	1,259,380,459.37
报告期期间基金总申购份额	1,258.75
减：报告期期间基金总赎回份额	200,010,041.59
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,059,371,676.53

§ 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	2017-7-1~2017-9-30	1,259,251,515.15	-	200,000,000.00	1,059,251,515.15	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。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于2017年7月12日发布了《关于融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本次基金份额持有人大会于2017年7月12日表决通过了《关于融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金降低管理费率及托管费率有关事项的议案》，决议自该日起生效。公告详情可查阅2017年7月12日在融通基金管理有限公司网站（www.rtfund.com）、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》发布的相关公告。

§ 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10月26日

融通新蓝筹证券投资基金

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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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9月30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	2,819,898,656.30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7月1日－2017年9月30日）
1.本期已实现收益	22,768,137.27
2.本期利润	70,187,960.62
3.加权平均基金份额本期利润	0.0245
4.期末基金资产净值	2,509,723,621.74
5.期末基金份额净值	0.8900

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；

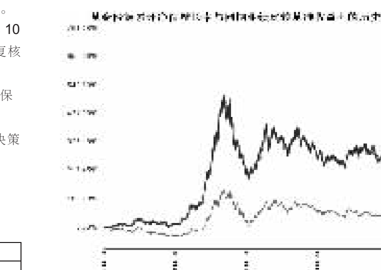
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	2.85%	0.53%	3.44%	0.44%	-0.59%	0.09%

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）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		
何龙	本基金的基金经理	2015年8月29日	-	5	何龙先生，武汉大学金融学硕士、华中科技大学经济学学士，5年证券投资从业经历，具有基金从业资格。2012年7月加入融通基金管理有限公司，历任融通研究员、策略研究员，现任融通新蓝筹混合基金的基金经理。
张延闽	本基金的基金经理、权益投资部总经理	2017年2月17日	-	7	张延闽先生，哈尔滨工业大学工学硕士、工学学士，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权益投资部总经理，2010年2月加入融通基金管理有限公司，现任融通通乾研究精选灵活配置混合（由原融通乾证券投资基金转型而来）、融通转型三动力灵活配置混合、融通新蓝筹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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本季度市场表现较好，万得全A指数涨幅为6.05%，其他各分类指数都呈现不同程度上涨。市场活跃度提高，主题和业绩齐飞。

本季度维持较高仓位，风格偏向行业龙头。我们对未来市场持乐观态度。种种迹象表明，A股将受益于居民财富的重新配置。三季度，本基金加仓了汽车，券商，地产。我们认为从逆向投资的角度来看，券商可能是下一阶段组合超额收益的重要来源。未来基金配置将会择机偏离，突出重点。

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0.8900元；本报告期基金份额净值增长率为2.85%，业绩比较基准收益率为3.44%。

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	1,832,668,154.57	72.71
	其中：股票	1,832,668,154.57	72.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	509,698,000.00	20.22
	其中：债券	509,698,000.00	20.22
	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	167,526,659.04	6.65
8	其他资产	10,488,709.29	0.42
9	合计	2,520,381,522.90	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	39,793.60	0.00
C	制造业	961,197,208.70	38.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,008,517.44	0.28
E	建筑业	131,294,911.64	5.23
F	批发和零售业	256,024,403.43	10.20
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,468.03	0.00
J	金融业	209,076,544.08	8.33
K	房地产业	209,319,676.80	8.34
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	40,350,473.80	1.61
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,654,958.82	0.27
R	文化、体育和娱乐业	11,658,626.32	0.46
S	综合	-	-
	合计	1,832,668,154.57	73.02

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	601933	永辉超市	32,039,802	255,998,017.98	10.20
2	600742	一汽富维	9,822,657	214,232,149.17	8.54
3	600048	保利地产	20,126,892	209,319,676.80	8.34
4	600085	同仁堂	4,756,338	154,152,914.58	6.14
5	601668	中国建筑	14,144,564	131,261,553.92	5.23
6	002475	立讯精密	5,159,929	106,604,133.14	4.25
7	000568	泸州老窖	1,636,282	91,795,420.20	3.66
8	601398	工商银行	13,690,767	82,144,602.00	3.27
9	000333	美的集团	1,849,110	81,712,170.90	3.26
10	600030	中信证券	4,267,800	77,631,282.00	3.09

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	509,698,000.00	20.31
	其中：政策性金融债	509,698,000.00	20.31
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	509,698,000.00	20.31

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	170204	17国开04	2,100,000	209,580,000.00	8.35
2	130238	13国开38	500,000	50,250,000.00	2.00
3	120247	12国开47	400,000	40,032,000.00	1.60
4	130245	13国开45	300,000	30,306,000.00	1.21
5	130421	13农发21	300,000	30,234,000.00	1.20

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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，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	名称	金额（元）
1	存出保证金	429,905.60
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,977,685.49
5	应收申购款	81,118.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,488,709.29

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	2,911,401,674.78
报告期期间基金总申购份额	6,253,765.04
减：报告期期间基金总赎回份额	97,756,783.52
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期期末基金份额总额	2,819,898,656.30

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	4,258,282.16
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	4,258,282.16
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.15

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内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新蓝筹证券投资基金设立的文件

（二）《融通新蓝筹证券投资基金基金合同》

（三）《融通新蓝筹证券投资基金托管协议》

（四）《融通新蓝筹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

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 http://www.rtfund.com 查询。

融通基金管理有限公司

2017年10月26日

融通新能源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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	融通新能源灵活配置混合
交易代码	001471
前端交易代码	001471
后端交易代码	001472
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月29日
报告期末基金份额总额	811,134,930.47份
投资目标	通过梳理新能源产业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	中证内地新能源主题指数收益率×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（2017年7月1日－2017年9月30日）
1.本期已实现收益	-5,846,776.61
2.本期利润	29,337,047.56
3.加权平均基金份额本期利润	0.0326
4.期末基金资产净值	975,416,137.76
5.期末基金份额净值	1.203

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。

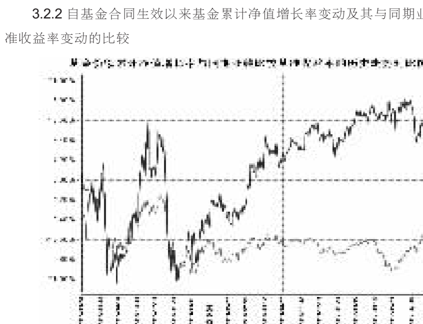
2.本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	3.71%	0.84%	8.87%	0.58%	-5.16%	0.26%

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	2015年6月29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

本基金本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1.203元；本报告期基金份额净值增长率为3.71%，业绩比较基准收益率为8.87%。

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	763,712,090.60	75.51
	其中：股票	763,712,090.60	75.51
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	245,762,190.74	24.30
8	其他资产	1,958,981.50	0.19
9	合计	1,011,433,262.84	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	19,235,400.00	1.97
B	采矿业	39,793.60	0.00
C	制造业	361,377,811.30	37.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,091,253.44	1.14
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	104,017,548.83	10.66
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	106,897,787.81	10.96
J	金融业	38,887,805.00	3.99
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	56,336,626.92	5.78
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	13,113,491.49	1.34
R	文化、体育和娱乐业	52,689,000.30	5.40
S	综合	-	-
	合计	763,712,090.60	78.30

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	4,468,894	103,991,163.38	10.66
2	603556	海兴电力	2,303,400	96,834,936.00	9.93
3	300365	恒华科技	2,185,875	81,904,736.25	8.40
4	300144	宋城演艺	2,812,199	52,644,365.28	5.40
5	600114	东睦股份	2,677,145	47,519,323.75	4.87
6	002127	南极电商	2,636,052	41,412,376.92	4.25
7	300115	长盈精密	1,140,937	39,442,192.09	4.04
8	300408	三环集团	1,535,300	37,753,027.00	3.87
9	603737	三棵树	562,655	37,095,844.15	3.80
10	300418	昆仑万维	944,971	24,975,583.53	2.56

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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，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	名称	金额（元）
1	存出保证金	741,490.69
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	52,974.03
5	应收申购款	1,164,516.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,958,981.50

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	999,056,313.23
报告期期间基金总申购份额	25,666,802.57
减：报告期期间基金总赎回份额	213,588,185.33
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	811,134,930.47

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	5,357,984.99
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	5,357,984.99
报告期期末管理人持有的本基金份额	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	直销赎回	2017年9月19日	-5,357,984.99	-6,327,780.27	0
合计			-5,357,984.99	-6,327,780.27	

§ 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新能源灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

（二）《融通新能源灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

（三）《融通新能源灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

（四）《融通新能源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

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