

融通中证人工智能主题指数证券投资基金(LOF)

2017年第三季度报告

权重的偏离,有效控制跟踪误差,为投资者提供投资中证人工智能指数的一个有效工具。

本基金在本报告期内,仍处于建仓期内,通过灵活的建仓策略,本基金报告期内净值增长率为5.10%。

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1.0890元;本报告期基金份额净值增长率为5.10%,业绩比较基准收益率为10.68%。

4.6 报告期内基金持有资产或基金资产净值预警说明

从2017年6月4日至2017年7月27日,本基金存在连续二十个工作日以上基金资产净值低于五千万元的情形。

从2017年8月1日至2017年9月16日,本基金存在连续二十个工作日以上基金资产净值低于五千万元的情形。

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§ 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	51,696,099.28	92.81
2	基金投资	51,696,099.28	92.81
3	固定收益投资	--	--
4	贵金属投资	--	--
5	金融衍生品投资	--	--
6	买入返售金融资产	--	--
7	银行存贷款和拆借资产合计	3,752,201.88	6.72
8	其他资产	426,862.89	0.76
9	合计	107,920,164.25	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	--	--
C	制造业	31,669,480.52	57.74
D	电力、热力、燃气及生产供应业	--	--
E	建筑业	--	--
F	交通运输业	--	--
G	信息技术业	--	--
H	金融业	--	--
I	房地产业	--	--
J	公共事业	--	--
K	其他行业	499,478.31	0.91
M	科学研发技术服务业	69,020.00	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	--	--
O	住宿和餐饮业	--	--
P	教育	--	--
Q	卫生和社会工作	--	--
R	文化、体育和娱乐业	--	--
S	综合	1,262,909.69	2.30
合计		51,696,099.28	94.16

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排

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	001919	东微电子	1,569,389	12,471,056.00	24.12
2	603042	一品红	857,234	11,076,026.00	21.63
3	600048	保利地产	1,041,300	10,929,520.00	21.37
4	600066	皖仪	331,864	10,756,712.24	20.97
5	600741	华仪电气	464,724	10,248,288.20	20.02
6	300146	中环环保	465,000	8,222,388.20	16.26
7	600020	中原证券	405,000	8,276,214.00	16.14
8	603048	伊亿股份	469,448	7,816,464.00	15.30
9	600058	吉药控股	120,206	7,440,452.00	14.51
10	600104	上海福南	207,800	6,276,301.00	12.38

5.4 报告期末按券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

的前十名债券投资明细

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	115,268,071.81	94.16
2	基金投资	115,268,071.81	94.16
3	固定收益投资	--	--
4	贵金属投资	--	--
5	金融衍生品投资	--	--
6	买入返售金融资产	--	--
7	银行存贷款和拆借资产合计	6,666,620.07	5.30
8	其他资产	738,673.21	0.61
9	合计	122,501,474.71	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	51,168.87	0.03
B	采矿业	51,168.87	0.03
C	制造业	64,363,642.22	53.06
D	电力、热力、燃气及生产供应业	12,466,162.31	10.31
P	教育	2,406,152.31	2.01
F	交通运输业	2,406,152.31	2.01
G	信息技术业	26,571.91	0.02
H	金融业	--	--
I	房地产业	1,271,461.75	1.05
J	公共事业	53,347,167.75	44.12
K	其他行业	10,029,520.00	8.32
M	科学研发技术服务业	--	--
N	水利、环境和公共设施管理业	--	--
O	住宿和餐饮业	--	--
P	教育	--	--
Q	卫生和社会工作	2,474,873.00	2.03
R	文化、体育和娱乐业	21,961.30	0.02
S	综合	--	--
合计		115,268,071.81	94.89

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排

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	001919	东微电子	1,569,389	12,471,056.00	24.12
2	603042	一品红	857,234	11,076,026.00	21.63
3	600048	保利地产	1,041,300	10,929,520.00	21.37
4	600066	皖仪	331,864	10,756,712.24	20.97
5	600741	华仪电气	464,724	10,248,288.20	20.02
6	300146	中环环保	465,000	8,222,388.20	16.26
7	600020	中原证券	405,000	8,276,214.00	16.14
8	603048	伊亿股份	469,448	7,816,464.00	15.30
9	600058	吉药控股	120,206	7,440,452.00	14.51
10	600104	上海福南	207,800	6,276,301.00	12.38

5.4 报告期末按券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

的前十名债券投资明细

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	106,410,408.04	92.59
2	基金投资	106,410,408.04	92.59
3	固定收益投资	10,006,000.00	8.83
4	贵金属投资	10,006,000.00	8.83
5	金融衍生品投资	--	--
6	买入返售金融资产	15,000,000.00	13.26
7	银行存贷款和拆借资产合计	130,764,689.28	115.26
8	其他资产	9,233,212.27	8.14
9	合计	226,779,497.32	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	9,739,512.20	8.53
C	制造业	140,560,620.06	124.17
D	电力、热力、燃气及生产供应业	21,000,000.00	18.54
E	建筑业	--	--
F	交通运输业	9,523,615.00	8.41
G	信息技术业	--	--
H	金融业	--	--
I	房地产业	--	--
J	公共事业	--	--
K	其他行业	6,069,476.63	5.38
L	科学研发技术服务业	--	--
M	水利、环境和公共设施管理业	--	--
N	住宿和餐饮业	--	--
O	教育	--	--
P	教育	--	--
Q	卫生和社会工作	--	--
R	文化、体育和娱乐业	4,300,200.54	3.84
S	综合	--	--
合计		189,410,828.84	166.42

5.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排

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	600063	自仪股份	211,400	12,247,320.00	4.89
2	000222	瀚宇电子	624,000	9,150,360.00	3.61
3	603228	瀚宇电子	504,000	8,530,200.00	3.26
4	601136	新华保险	128,584	7,210,488.00	2.83
5	000729	天润科技	120,764	6,989,280.00	2.74
6	000898	英派斯	571,600	6,426,288.00	2.57
7	600028	中国石化	132,000	6,400,000.00	2.50
8	600030	中信证券	591,600	6,176,960.00	2.41
9	600032	通程控股	294,288	6,075,264.00	2.38
10	300063	立讯精密	199,388	6,042,048.00	2.36

5.4 报告期末按券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

的前十名债券投资明细

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

的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排

的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排

的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排

的前十名债券投资明细

本基金本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

的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排

的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排

的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排

的前十名债券投资明细

本基金本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

的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排

的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排

的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排

的前十名债券投资明细

本基金本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

的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排

的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排

的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排

的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排

的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.23 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排

的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.24 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排

的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.25 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排

的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.26 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排

的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.27 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排

的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.28 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排

的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.29 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排

的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.30 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排

的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.31 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排

的前十名债券投资明细