融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)

2018年第三季度报告

基金管理人:融通基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2018年10月24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2018年10月22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2018年7月1日起至2018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	655,108,676.56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	654,819,863.13份 288,813.43份

§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(2018年7月1日 – 2018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	-8,286,149.45	-3,558.66
2. 本期利润	10,915,117.06	3,914.25
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0166	0.0133
4. 期末基金资产净值	707,740,889.43	279,180.46
5. 期末基金份额净值	1.081	0.967

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 本报告期融通巨潮100指数A/B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

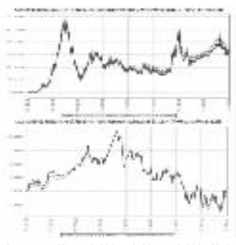
融通巨潮100指数A/B

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	1.60%	1.37%	0.35%	1.34%	1.25%	0.03%

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	1.47%	1.36%	0.35%	1.34%	1.12%	0.02%

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:1、本基金于2017年7月5日增设C类份额,本基金C类份额的统计区间为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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
蔡志伟	本基金的基金经理	2015年2月11日	–	7	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),7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1.081元,本报告期基金份额净值增长率为1.60%;截至本报告期末融通巨潮100指数C基金份额净值为0.967元,本报告期基金份额净值增长率为1.47%;同期业绩比较基准收益率为0.35%。

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	671,460,247.92	94.59
	其中:股票	671,460,247.92	94.59
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	20,051,000.00	2.82
	其中:债券	20,051,000.00	2.82
	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	17,071,104.21	2.40
8	其他资产	1,318,671.39	0.19
9	合计	709,901,023.52	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数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	9,350,508.24	1.32
B	采矿业	25,862,653.64	3.65
C	制造业	234,321,180.50	33.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,697,556.09	1.93
E	建筑业	20,312,753.82	2.87
F	批发和零售业	5,187,807.00	0.73
G	交通运输、仓储和邮政业	8,868,000.64	1.25
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,587,416.11	1.78
J	金融业	300,811,575.39	42.49
K	房地产业	22,798,486.36	3.22
L	租赁和商务服务业	6,730,102.86	0.95
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	660,528,040.65	93.29

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	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	5,365,839.99	0.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	1,438,446.00	0.20
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	–
J	金融业	4,127,921.28	0.58
K	房地产业	–	–
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	10,932,207.27	1.54

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	1,011,234	69,269,529.00	9.78
2	600036	招商银行	1,156,123	35,481,414.87	5.01
3	600519	贵州茅台	45,047	32,884,310.00	4.64
4	601166	兴业银行	1,444,131	23,033,889.45	3.25
5	601288	农业银行	5,209,508	20,264,986.12	2.86
6	000651	格力电器	455,374	18,306,034.80	2.59
7	000333	美的集团	415,037	17,460,606.59	2.47
8	600276	恒瑞医药	267,873	17,009,935.50	2.40
9	600030	中信证券	982,300	16,394,587.00	2.32
10	601328	交通银行	2,544,387	14,859,220.08	2.10

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	601138	工业富联	351,533	4,436,346.46	0.63
2	002142	宁波银行	232,428	4,127,921.28	0.58
3	600350	山东高速	321,800	1,438,446.00	0.20
4	600525	长园集团	111,600	839,232.00	0.12
5	002937	兴瑞科技	2,114	36,593.34	0.01

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	20,051,000.00	2.83
	其中:政策性金融债	20,051,000.00	2.83
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	20,051,000.00	2.83

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	180407	18农发07	100,000	10,044,000.00	1.42
2	170211	17国开11	100,000	10,007,000.00	1.41

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国债期货。

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	42,858.21
2	应收证券清算款	723,947.93
3	应收股利	–
4	应收利息	510,885.33
5	应收申购款	40,979.92
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	1,318,671.39

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000333	美的集团	17,460,606.59	2.47	重大事项停牌

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601138	工业富联	4,436,346.46	0.63	新股流通受限

§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	657,559,095.98	301,380.39
报告期期间基金总申购份额	5,739,853.22	16,441.80
减:报告期期间基金总赎回份额	8,479,086.07	29,008.76
报告期期间基金拆分变动份额	–	–
报告期期末基金份额总额	654,819,863.13	288,813.43

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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

2018年10月24日

融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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:2018年10月24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2018年10月22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2018年7月1日起至2018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	1,010,359,580.66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(2018年7月1日 – 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	3,370,488.20
2.本期利润	9,998,864.15
3.加权平均基金份额本期利润	0.0099
4.期末基金资产净值	1,052,236,459.21
5.期末基金份额净值	1.041

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。

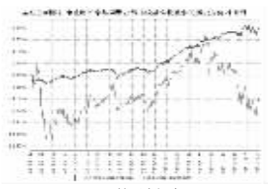
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	0.87%	0.22%	-0.60%	0.67%	1.47%	-0.45%

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
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	–	12	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)。12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,现任融通通盈保本混合、融通新机遇灵活配置混合、融通通裕定期开放债券发起式、融通收益增强债券、融通通昊定期开放债券发起式基金的基金经理。
余志勇	本基金的基金经理、研究部总监	2015年11月17日	–	18	余志勇先生,武汉大学金融学硕士、工商管理学学士,18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,现任融通通泰保本混合、融通通鑫灵活配置混合、融通新机遇灵活配置混合、融通四季添利债券(LOF)、融通通润债券、融通通颐定期开放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

本基金的投资目标是绝对收益,同时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。

三季度由于中美贸易摩擦带来的负面困扰不断发酵，加上经济数据呈现缓慢下降的趋势,市场风险偏好不断降低,整体市场走势低迷,本基金权益仓位一直保持在较低水平,资产配置也比较均衡,基金表现好于市场平均水平。

展望四季度我们对股市不悲观,主要是A股市场整体估值已经处于历史很低的水平,中国经济的韧性也可能好于市场预期,因此在投资策略上我们会继续采取相对均衡配置的阿尔法策略,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1.041元；本报告期基金份额净值增长率为0.87%,业绩比较基准收益率为-0.60%。

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	141,146,804.86	10.55
	其中:股票	141,146,804.86	10.55
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	1,111,600,530.23	83.10
	其中:债券	1,111,600,530.23	83.10
	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	61,109,597.94	4.57
8	其他资产	23,873,038.52	1.78
9	合计	1,337,729,971.55	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	653,632.00	0.06
B	采矿业	4,849,397.00	0.46
C	制造业	92,277,174.98	8.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	1,739,536.00	0.17
F	批发和零售业	6,252,840.00	0.59
G	交通运输、仓储和邮政业	1,172,690.00	0.11
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,932,679.00	0.56
J	金融业	8,525,296.27	0.81
K	房地产业	5,401,198.72	0.51
L	租赁和商务服务业	9,014,826.64	0.86
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	3,278,309.25	0.31
R	文化、体育和娱乐业	2,049,225.00	0.19
S	综合	–	–
	合计	141,146,804.86	13.41

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	601888	中国国旅	132,532	9,014,826.64	0.86
2	600801	华新水泥	381,000	7,673,340.00	0.73
3	600276	恒瑞医药	97,980	6,221,730.00	0.59
4	300630	普利制药	93,700	5,881,549.00	0.56
5	000338	潍柴动力	518,500	4,433,175.00	0.42
6	600031	三一重工	468,700	4,162,056.00	0.40
7	600585	海螺水泥	109,800	4,039,542.00	0.38
8	002304	洋河股份	30,700	3,929,600.00	0.37
9	000661	长春高新	14,000	3,318,000.00	0.32
10	000932	华菱钢铁	393,000	3,297,270.00	0.31

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	247,396,000.00	23.51
	其中:政策性金融债	216,577,000.00	20.58
4	企业债券	254,841,417.00	24.22
5	企业短期融资券	20,164,000.00	1.92
6	中期票据	423,435,500.00	40.24
7	可转债(可交换债)	1,583,613.23	0.15
8	同业存单	134,009,000.00	12.74
9	其他	30,171,000.00	2.87
10	合计	1,111,600,530.23	105.64

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	800,000	80,272,000.00	7.63
2	180409	18农发09	500,000	50,690,000.00	4.82
3	136768	16苏海01	500,000	46,040,000.00	4.38
4	160415	16农发15	400,000	40,004,000.00	3.80
5	136177	16电气债	400,000	39,928,000.00	3.79

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

在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理,以套期保值为目的,对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险,提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。若法律法规或监管机构以后允许基金投资如期权、互换等其他金融衍生品种,本基金将以风险管理和组合优化为目的,根据届时法律法规的相关规定参与投资。

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,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	18,146.61
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	23,854,891.91
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	23,873,038.52

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	132007	16凤凰EB	925,155.00	0.09
2	127005	长证转债	592,844.00	0.06

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	1,010,363,256.11
报告期期间基金总申购份额	23,716.81
减:报告期期间基金总赎回份额	27,392.26
报告期期末基金份额总额	1,010,359,580.66

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内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	20180701-20180930	1,010,231,515.15	–	–		1,010,231,515.15	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http://www.rtfund.com查询。

融通基金管理有限公司

2018年10月24日

融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:融通基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:2018年10月24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2018年10月22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2018年7月1日起至2018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	1,359,511,023.22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	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