融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31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:2016年1月22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2016年1月19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2015年10月1日起至2015年12月31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	2,348,993,316.54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置股票资产;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(2015年10月1日 — 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-25,996,053.45
2.本期利润	314,432,918.35
3.加权平均基金份额本期利润	0.1306
4.期末基金资产净值	1,721,052,478.21
5.期末基金份额净值	0.733

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损益。

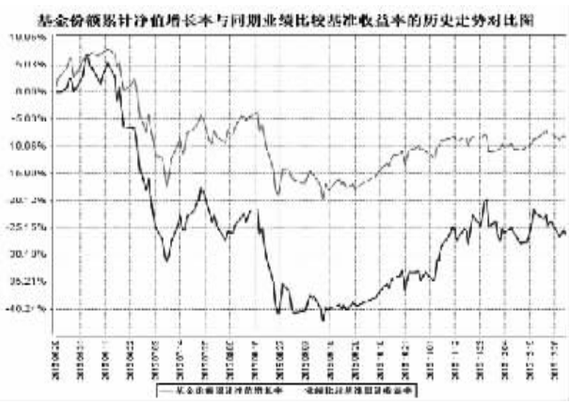
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	21.36%	2.33%	10.71%	1.00%	10.65%	1.33%

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、本基金合同生效日为2015年5月20日。

2、本基金的建仓期为自基金合同生效日起6个月。截至报告期末,各项资产配置比例符合规定。

§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、融通动力先锋股票、融通内需驱动股票的基金经理	2015年5月20日	-	5	金融学硕士,毕业于北京大学光华管理学院,具有基金从业资格。2010年7月至2014年12月在华夏基金管理有限公司投资研究部工作,历任研究员、TMT研究组长。2014年12月加入融通基金管理有限公司。
刘格菘	本基金、融通新能源灵活配置混合、融通领先成长股票(LOF)、融通互联网传媒灵活配置混合、融通成长30灵活配置混合的基金经理	2015年5月20日	-	5	经济学博士,毕业于中国人民银行研究生部,具有基金从业资格。曾任职于中国人民银行营业管理部,历任中邮创业基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、中邮核心成长股票型证券投资基金基金经理。2014年9月加入融通基金管理有限公司。

注:任职日期根据基金管理人对外披露的任职日期填写。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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年四季度,在经历系统性暴跌之后,市场慢慢走了出来,尤其是10月和11月,市场呈现单边上涨的态势,四季度上证综指上涨15.93%,创业板上涨30.32%,各个板块均有不同程度上涨,其中以TMT板块涨幅居前。

报告期内,本基金主要仓位配置在新兴成长行业,包括教育、IP、互联网等领域,以及一些新兴行业的转型股,这些领域代表了未来的方向。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为21.36%,同期业绩比较基准收益率为10.71%。

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	1,335,082,214.69	77.05
	其中:股票	1,335,082,214.69	77.05
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	240,994,313.63	13.91
8	其他资产	156,655,054.52	9.04
9	合计	1,732,731,582.84	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	-	-
B	采矿业	42,592,197.44	2.47
C	制造业	809,031,771.58	47.01
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	255,322,172.37	14.84
J	金融业	-	-
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	108,371,272.80	6.30
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	119,764,800.50	6.96
S	综合	-	-
	合计	1,335,082,214.69	77.57

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	300008	上海佳豪	4,074,108	108,371,272.80	6.30
2	300202	聚龙股份	3,303,101	106,326,821.19	6.18
3	002667	鞍重股份	1,238,426	92,634,264.80	5.38
4	002599	盛通股份	2,198,014	89,547,090.36	5.20
5	002127	新民科技	4,767,315	89,244,136.80	5.19
6	002343	禾欣股份	1,386,875	84,183,312.50	4.89
7	600446	金证股份	1,634,921	80,421,763.99	4.67
8	300025	华星创业	2,465,603	69,727,252.84	4.05
9	002085	万丰奥威	1,765,457	56,812,406.26	3.30
10	600485	信威集团	1,998,878	53,469,986.50	3.11

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

本基金本报告期末投资国债期货。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

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	5,042,489.87
2	应收证券清算款	151,336,301.31
3	应收股利	-
4	应收利息	53,631.16
5	应收申购款	222,632.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	156,655,054.52

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

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	300025	华星创业	69,727,252.84	4.05	资产重组

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,461,711,429.83
报告期期间基金总申购份额	50,502,100.67
减:报告期期间基金总赎回份额	163,220,213.96
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	2,348,993,316.54

§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新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

(二)《融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

(三)《融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(四)《融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

(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

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

2016年1月22日

融通中证军工指数分级证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31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:2016年1月22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2016年1月16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,投资者在做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2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通军工分级		
场内简称	融通军工		
交易代码	161628		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年7月1日		
报告期末基金份额总额	223,509,071.70份		
投资目标	本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪中证军工指数。在正常市场情况下,力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。		
投资策略	本基金采用完全复制法进行投资,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动对投资组合进行相应调整。		
业绩比较基准	95%×中证军工价格指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率(税后)。		
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高预期风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看,融通军工A份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征;融通军工B份额具有高预期风险、预期收益相对较高的特征。		
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		
下属分级基金简称	融通军工分级	军工股A	军工股B
下属分级场内简称	融通中证军工	军工股A	军工股B
下属分级基金交易代码	161628	150335	150336
下属分级基金报告期末基金份额总额	102,336,439.70份	60,586,316.00份	60,586,316.00份
下属分级基金的风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高预期风险、较高预期收益的特征。	融通军工股A份额为稳健收益类份额,具有低预期风险、预期收益相对稳定的风险收益特征	融通军工股B份额为积极收益类份额,具有高预期风险、预期收益相对较高的风险收益特征。

§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(2015年10月1日 — 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-1,675,428.56
2.本期利润	27,666,629.14
3.加权平均基金份额本期利润	0.1301
4.期末基金资产净值	232,989,854.40
5.期末基金份额净值	1.042

注:1、本基金合同生效日为2015年7月1日。

2、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。

3、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	16.28%	2.25%	18.67%	2.23%	-2.39%	0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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、本基金合同生效日为2015年7月1日。

2、本基金的建仓期为自合同生效日起6个月,截止报告期末,各项资产配置比例符合规定。

§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		
何天翔	本基金、融通深证100指数、融通证券分级、融通农业分级的基金经理	2015年7月1日	-	6	硕士,具有基金从业资格。2008年7月至2010年3月在华泰联合证券有限公司工作,任金融工程分析师;2010年3月加入融通基金管理有限公司,历任金融工程研究员、专户投资投资经理。

注:任职日期根据基金管理人对外披露的任职日期填写;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始终。报告期内,本基金处于建仓期,考虑到市场指数以及本基金目标指数期间内波动较大,以及较多成分股停牌等因素,本基金采取灵活建仓的投资策略,报告期末仓位达到90%以上,本基金运用指数化投资策略,在建仓期满之前使得仓位符合合同规定,为投资者提供一个投资中证军工指数的有效工具。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2015年第四季度市场整体上涨,宽基指数中沪深300指数上涨16.49%,中小板指数和创业板指数分别上涨23.81%、30.32%。融通中证军工指数分级基金比较基准在2015年第四季度上涨18.67%,同期融通中证军工指数分级基金净值上涨16.28%。

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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	219,029,263.78	89.79
	其中:股票	219,029,263.78	89.79
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	24,847,699.58	10.19
7	其他资产	65,910.56	0.03
8	合计	243,942,873.92	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	202,719,194.11	87.01
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	2,367,896.44	1.02
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,752,594.63	5.47
J	金融业	-	-
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	1,189,578.60	0.51
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	219,029,263.78	94.01

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末无积极投资部分的股票。

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	601989	中国重工	2,343,153	22,025,638.20	9.45
2	600893	中航动力	230,341	10,372,255.23	4.45
3	600271	航天信息	126,481	9,038,332.26	3.88
4	002465	海格通信	494,859	8,259,196.71	3.54
5	000768	中航飞机	327,085	8,101,895.45	3.48
6	600118	中国卫星	174,777	7,435,013.58	3.19
7	600150	中国船舶	203,600	7,091,388.00	3.04
8	600839	四川长虹	1,090,388	6,313,346.52	2.71
9	002049	同方国芯	92,301	5,551,905.15	2.38
10	600482	风帆股份	110,983	5,221,750.15	2.24

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

本基金本报告期末无积极投资部分的股票。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

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	57,658.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,062.21
5	应收申购款	1,189.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	65,910.56

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	600271	航天信息	9,038,332.26	3.88	重大事项停牌
2	002465	海格通信	8,259,196.71	3.54	重大事项停牌
3	002049	同方国芯	5,551,905.15	2.38	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

本基金本报告期末无积极投资部分的股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	融通军工分级	军工股A	军工股B
报告期期初基金份额总额	126,507,663.26	36,816,018.00	36,816,018.00
报告期期间基金总申购份额	212,975,934.88	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	193,115,549.32	-	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-44,031,609.12	23,770,298.00	23,770,298.00
报告期期末基金份额总额	102,336,439.70	60,586,316.00	60,586,316.00

注:拆分变动份额为本报告期发生的配对转换份额和定期折算份额。

§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)《融通中证军工指数分级证券投资基金基金合同》

(二)《融通中证军工指数分级证券投资基金金托管协议》

(三)《融通中证军工指数分级证券投资基金招募说明书》

(四)融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照

(五)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

2016年1月22日

融通新能源灵活配置混合型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31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:2016年1月22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2016年1月18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2015年10月1日起至2015年12月31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	1,762,571,147.52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(2015年10月1日 — 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	589,984,869.07
2.本期利润	740,010,672.83
3.加权平均基金份额本期利润	0.2778
4.期末基金资产净值	1,865,089,514.36
5.期末基金份额净值	1.058

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。

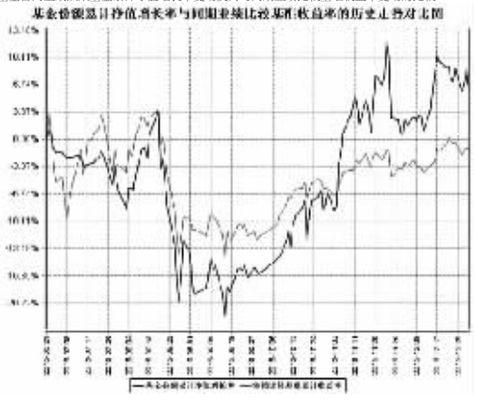
2.本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	26.86%	2.20%	12.23%	0.93%	14.63%	1.27%

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



1、本基金合同生效日为2015年6月29日。

2、本基金的建仓期为自基金合同生效日起6个月。截至本报告期末,各项资产配置比例符合合同约定。

§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	2015-06-29	-	5	毕业于清华大学,获物理学博士,5年证券从业经验,具有基金从业资格。2010年7月至2011年4月在中信证券工作,任研究员。2011年5月至2014年9月在瑞银证券工作,任研究员。2014年10月加入融通基金管理有限公司,任制造业组组长。
刘格菘	本基金、融通领先成长股票(LOF)、融通新区域新经济灵活配置混合、融通互联网传媒灵活配置混合、融通成长30灵活配置混合的基金经理	2015-06-29	-	5	经济学博士,毕业于中国人民银行研究生部,具有基金从业资格,曾任职于中国人民银行营业管理部,历任中邮创业基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、中邮核心成长股票型证券投资基金基金经理。2014年9月加入融通基金管理有限公司。

注:任职日期根据基金管理人对外披露的任职日期填写;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

2015年四季度,市场整体呈现单边上涨后横盘的态势。三季度上证综指上涨15.93%,深证成指上涨26.80%,创业板上涨30.32%。

融通新能源主要仓位配置在新兴成长行业,包括新能源汽车、消费升级、传媒、教育、现代服务业等领域。由于我们对市场的看法积极,因此十一之后我们持续加仓,此后保持在较高的仓位下运行。

未来资产配置的方向依然将集中在新兴成长方向,因为我们认为,创新和转型是未来的方向。目前中国经济结构分化明显,重化工领域依然在持续下降,而以新消费升级为代表的“物质消费”向“精神消费”转化的动力依然强劲。从细分行业的角度看,新能源汽车、大数据、大健康以及以娱乐、教育、体育、旅游为主的消费升级、现代服务业等是配置的重点。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为26.86%,同期业绩比较基准收益率为12.23%。

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	1,640,301,906.61	86.45
	其中:股票	1,640,301,906.61	86.45
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	193,425,310.55	10.19
8	其他资产	63,653,458.77	3.35
9	合计	1,897,380,675.93	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	18,898,336.80	1.01
B	采矿业	-	-
C	制造业	822,274,862.52	44.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	168,967,851.05	9.06
F	批发和零售业	167,652,701.20	8.99
G	交通运输、仓储和邮政业	24,973,522.80	1.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	95,459,986.97	5.12
J	金融业	-	-
K	房地产业	156,951,748.87	8.42