融通新蓝筹证券投资基金

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20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12月31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	3,138,757,192.10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

注:本基金自2015年10月1日起启用新的业绩比较基准:“沪深300指数收益率×75%+中债综合全价(总值)指数收益率×25%”。详见本基金管理人于2015年11月11日发布的《融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金变更业绩比较基准及修改相关基金合同的公告》。

§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	257,694,420.98
2.本期利润	527,322,257.06
3.加权平均基金份额本期利润	0.1621
4.期末基金资产净值	3,841,789,826.19
5.期末基金份额净值	1.2240

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;

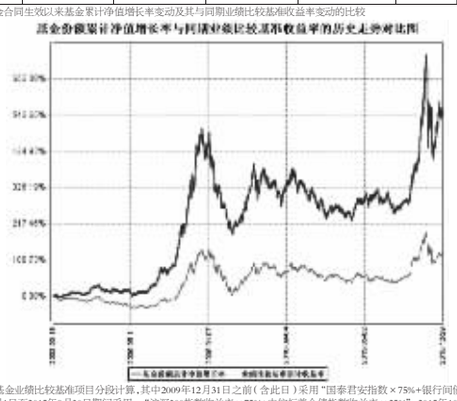
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	14.62%	1.81%	12.81%	1.25%	1.81%	0.56%

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	-	3	华中科技大学经济学学士,武汉大学金融学硕士,3年证券从业经验,具有基金从业资格,2012年7月加入融通基金管理有限公司,任金融研究员、策略研究员。

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,在投权、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业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年四季度,A股延续了始于9月份的灾后反弹,本季度,上证50上涨12.80%,沪深300上涨16.49%,中小板指数上涨23.81%,创业板指数上涨30.32,成长股是二季度去杠杆的重灾区,超跌反弹也是急先锋。从行业上看,本季度以地产为首的低估值的周期板块因为险资举牌概念,在季度末期出现了明显的上涨,而高弹性的T中小创也在最后一个月出现分化。

在这轮反弹初期,考虑到弹性,新蓝筹大规模调仓至中小创,降低了传统周期类相关资产配置。而在反弹后期,鉴于周期股的宏观背景并不乐观,我们在降低了中小创仓位的情况下,并未跟随市场追涨绩优蓝筹板块,并维持中性仓位至年末;我们当前的配置核心是传统行业的转型主题+景气组合,传统行业转型应是未来永恒不变的方向,我们看好供应链金融在未来行业整合转型中的作用。另外,信息领域的互联网+也是我们看好的方向,高景气方面,我们配置了传媒影视和VR板块。

展望2016年一季度,流动性的相对宽松预计将继续维持,政策上以十三五规划作为抓手来不断深化供给侧改革的思路也逐步清晰;经济数据依旧暗软,企业盈利仍有待时日,海外局势依然会有不确定性,油价的波动较大、美国何时开启第二轮加息以及日欧经济的复苏情况,都可能会对市场造成一定的影响,因此在注册制继续推进,且去产能继续进行的情况下,16年整体趋势性机会不大,更多的是结构性的机会为主,配置上更加偏均衡,以免对收益的思路,参与较为确定的机会。

短期看,一月份开局市场超跌较多,短期市场出现了极端的跌幅,主要原因是人民币出现了较为快速的下跌,压制市场情绪,并让熔断机制连续触发,恐慌情绪传导,未来一段时间内市场的波动幅度依然较为剧烈,但是情绪化的恐慌也注定导致市场超跌因素较为强烈,风险偏好会缓慢正常修复。加上流动性宽松大局不变,部分强势板块可能会维持高弹性、板块上,未来半年内我们看好在改革中充分释放效率的国企改革、军工等板块、成长股中,我们将更多的关注高端装备、云计算和消费升级等领域的投资机会,此外,行业配置方面我们也会布局受益于供给侧改革的传统周期龙头。

综上所述,融通新蓝筹基金将会继续坚持“核心周期龙头+优质成长股”的组合构建思路,精选个股,在保持结构基本稳定的同时精选个股,力争为持有人获取风险调整后的稳定收益。

4.4.2 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14.62%,同期业绩比较基准收益率为12.81%。

4.5 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	2,790,973,191.89	71.09
	其中:股票	2,790,973,191.89	71.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	858,488,000.00	21.87
	其中:债券	858,488,000.00	21.87
	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	245,015,198.53	6.24
8	其他资产	31,504,661.16	0.80
9	合计	3,925,981,051.58	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	82,854,201.56	2.16
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,043,075,025.66	53.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	75,233,844.50	1.96
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	45,059,288.46	1.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,055,483.01	0.44
J	金融业	-	-
K	房地产业	33,807,781.68	0.88
L	租赁和商务服务业	81,925,171.72	2.13
M	科学研究和技术服务业	48,639,224.60	1.27
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	363,323,170.70	9.46
S	综合	-	-
	合计	2,790,973,191.89	72.65

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	002085	万丰奥威	11,831,581	380,740,276.58	9.91
2	600687	刚泰控股	15,955,059	376,220,291.22	9.79
3	300429	强力新材	1,995,422	277,363,658.00	7.22
4	002488	金固股份	9,545,957	276,832,753.00	7.21
5	002343	禾欣股份	3,104,981	188,472,346.70	4.91
6	002045	国光电器	9,852,287	186,208,224.30	4.85
7	300364	中文在线	982,308	174,850,824.00	4.55
8	002260	德奥通航	3,711,646	167,766,399.20	4.37
9	300285	国瓷材料	3,641,785	165,701,217.50	4.31
10	002592	八菱科技	1,939,799	85,739,115.80	2.23

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	858,488,000.00	22.35
	其中:政策性金融债	858,488,000.00	22.35
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	858,488,000.00	22.35

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	150307	15进出07	1,200,000	120,396,000.00	3.13
2	150211	15国开11	1,000,000	100,290,000.00	2.61
3	130237	13国开37	600,000	60,816,000.00	1.58
4	150305	15进出05	500,000	52,855,000.00	1.38
5	130238	13国开38	500,000	52,385,000.00	1.36

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被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

海通证券股份有限公司(以下简称“本公司”或“公司”)于2015年11月26日收到中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《调查通知书》(稽查总队调查通字153122号)。因公司涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定,根据《中华人民共和国证券法》的有关规定,中国证监会决定对公司进行立案调查。

海通证券上海建国西路营业部和杭州解放路营业部对杭州恒生网络技术服务有限责任公司 HOMS系统(以下简称HOMS系统)开放专线接入,其中第一条专线于2014年3月由零售与网络金融部、信息技术管理部、合规与风险管理总部平行审核后接入上线。第二条专线于2015年2月由零售与网络金融部、合规与风险管理总部、信息技术管理部平行审核后接入上线。对于上述外部接入第三方交易终端软件,海通证券未进行软件认证许可,未对外部系统接入实施有效管理,对相关客户身份情况缺乏了解。

截止调查日,海通证券客户中,有120个使用HOMS系统接入的主账户。对上述客户,海通证券未按要求采集客户交易终端信息,未能确保客户交易终端信息的真实性、准确性、完整性、一致性、可溯性,未采取可靠措施采集、记录与客户身份识别有关的信息。

海通证券通过添加白名单方式允许客户使用HOMS系统进行交易,缺少实质性审核。在客户回访方面,海通证券员然对客户进行了回访,但在回访时没有对客户交易委托电话、IP、MAC等与客户进行全面核对。使用HOMS系统进行分仓交易的账户由于操作子账户多,主账户的交易较为频繁、异常,明显不同于其他普通账户,但海通证券没有对该等账户重点关注,缺少有效监督。海通证券在未采集、上述客户身份识别信息的情况下,未实施有效的了解客户身份的回访、检查等程序。

综上,海通证券未按照《证券登记结算管理办法》第二十四条、《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条、《中国证监会关于加强证券经纪业务管理的规定》第三条第(四)项、《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户的身份信息进行审查和了解,违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定,构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第(四)项所述的行为,获利2865.3万元。时任海通证券零售与网络金融部总经理丁学清及第二海、信息技术管理部总经理沈云明、合规与风险管理总部副总经理未世浩是直接责任的主管人员,宁波百丈东路营业部前台负责人高宏杰、宁波百丈东路营业部总经理方贤明、杭州解放路营业部副总经理汪峰为其他直接责任人员。根据当事人违法行为的事实、性质、情节和社会危害程度,依据《证券公司监督管理条例》第八十四条的规定,我会拟决定:一、对海通证券责令改正,给予警告,没收违法所得28,653,000元,并处以85,959,000元罚款;二、对丁学清给予警告,并处以10万元罚款;三、对邹二海给予警告,并处以10万元罚款;四、对高宏杰给予警告,并处以10万元罚款;五、对汪峰给予警告,并处以5万元罚款;六、对方贤明给予警告,并处以5万元罚款;七、对沈云明给予警告,并处以5万元罚款;八、对未世浩给予警告,并处以5万元罚款。

华泰证券

2015年9月10日,公司收到中国证券监督管理委员会《行政处罚事先告知书》(处罚字[2015]72号),华泰证券涉嫌违法违规的事实如下:2013年7月29日,华泰证券威宁路营业部应客户上海朝兴置业有限公司(以下简称朝兴置业)的要求,与杭州恒生网络技术服务有限公司(以下简称恒生网络)共同测试HOMS系统接入华泰证券软件系统。系统连通后,在朝兴置业未使用的情况下,华泰证券并未切断其与HOMS系统的连接端口,也未对此专线设置相应监控。2014年10月至12月期间,华泰证券在对于自身交易系统没有采取预防措施的情况下,让浙江核新同花顺网络信息股份有限公司(以下简称同花顺)工程人员在华泰证券机房安装了资产管理模块。对于上述外部接入的第三方交易终端软件,华泰证券未进行软件认证许可,未对外部系统接入实施有效管理,对相关客户身份情况缺乏了解。

依据《证券公司监督管理条例》第八十四条第(四)项的规定,我会拟决定:一、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;二、对胡智给予警告,并处以10万元罚款;三、对陈栋给予警告,并处以10万元罚款。

本基金期间策略性投资持有上述两家公司股少量股份,会尽快妥善处理。

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	257,112.52
2	应收证券清算款	2,685,671.13
3	应收股利	-
4	应收利息	13,537,664.92
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,480,448.57

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	300463	迈克生物	27,390,960.87	1.15	新股锁定
2	300443	金雷风电	12,675,219.12	0.53	新股锁定
3	300436	广生堂	7,891,977.42	0.33	新股锁定

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,575,535,460.65
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	166,983,924.70
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	2,408,551,535.95

§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)融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金份额持有人大会决议生效的公告

(二)《融通通泽灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

(三)《融通通泽灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(四)《融通通泽灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

(五)中国证监会批准融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

(六)融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照

(七)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、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
2016年1月22日

融通通泽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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月15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	融通通泽灵活配置混合
交易代码	000278
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月2日
报告期末基金份额总额	2,408,551,535.95份
投资目标	本基金在追求本金安全的基础上,通过大类资产配置与个券选择,采用数量化手段严格控制本基金的下行风险,力争在减小波动性的同时,为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。
投资策略	本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略,将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、行业细分、公司价值评估以及组合风险管理全过程中。
业绩比较基准	年化收益率8%。
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与货币市场基金,低于股票型基金,属于中高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(2015年10月1日 — 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	5,832,692.63
2.本期利润	52,496,786.91
3.加权平均基金份额本期利润	0.0212
4.期末基金资产净值	2,389,771,063.49
5.期末基金份额净值	0.992

注:(1)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。

(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损益。

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	2.06%	0.13%	2.02%	0.00%	0.04%	0.13%

注:1、本基金由《融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金》转型而来,本基金转型后的基金合同生效日为2014年9月2日。

2、本基金转型后的建仓期为转型后合同生效日起6个月。截至本报告期末,各项资产配置比例符合合同约定。

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		
余志勇	本基金、融通通泰保本、融通通鑫灵活配置混合、融通通泽灵活配置混合的基金经理	2015年2月25日	-	14	金融学硕士,具有基金从业资格。先后任职于湖北省农业厅、闽发证券、2004年加入招商证券股份有限公司研究发展中心,从事房地产行业研究工作。2007年加入融通基金管理有限公司,曾任研究部行业研究员、行业组长。

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,在投权、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

考虑到本基金设计的目的主要是为了保持基金净值增长率的平稳性,原来操作策略是保持低仓位,用更多的资金积极参与新股的发行,取得相对稳定的收益;同时将富余的资金适当的配置在高流动性债券和回购类资产,获得较好的基础性收益。

由于前期IPO被暂停,原有的操作策略一度受到了冲击,本基金在三季度大盘底部适度增持了一部分股票,随着市场估值修复,本基金则逐步降低了股票仓位,整体风险控制得较好。在11月份IPO重启后,本基金又重新调整到以新股中购为主的策略。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内基金份额净值增长率为2.06%,同期业绩比较基准收益率为2.02%。

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	91,403,126.10	3.82
	其中:股票	91,403,126.10	3.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,366,206,600.00	57.07
	其中:债券	1,366,206,600.00	57.07
	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	593,701,610.55	24.80
	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	325,963,039.29	13.62
8	其他资产	16,480,448.57	0.69
9	合计	2,393,754,824.51	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	70,107,360.67	2.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	195,136.20	0.01
F	批发和零售业	222,304.44	0.01
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	7,336,208.18	0.31
J	金融业	12,450,000.00	0.52
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	109,392.21	0.00
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	982,724.40	0.04
S	综合	-	-
	合计	91,403,126.10	3.82

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	300463	迈克生物	233,333	27,390,960.87	1.15
2	300443	金雷风电	65,566	12,675,219.12	0.53
3	600837	海通证券	600,000	9,492,000.00	0.40
4	002157	正邦科技	400,000	8,040,000.00	0.34
5	300436	广生堂	94,594	7,891,977.42	0.33
6	002217	合力泰	300,000	5,085,000.00	0.21
7	300271	华宇软件	100,000	4,748,000.00	0.20
8	600439	瑞贝卡	500,000	3,550,000.00	0.15
9	002127	新民科技	162,700	3,045,744.00	0.13
10	601688	华泰证券	150,000	2,958,000.00	0.12

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	519,892,600.00	21.75
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	620,912,000.00	25.98
6	中期票据	225,402,000.00	9.43
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,366,206,600.00	57.17

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	020080	15贴现06	3,960,000	389,703,600.00	16.31
2	101551055	15大连万达MTN001	2,000,000	204,680,000.00	8.56
3	011501003	15中石油SCP003	2,000,000	200,100,000.00	8.37
4	011534008	15东航股SCP008	1,200,000	119,976,000.00	5.02
5	011513003	15招商局SCP003	1,000,000	100,320,000.00	4.20

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被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

海通证券股份有限公司(以下简称“本公司”或“公司”)于2015年11月26日收到中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《调查通知书》(稽查总队调查通字153122号)。因公司涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定,根据《中华人民共和国证券法》的有关规定,中国证监会决定对公司进行立案调查。

海通证券上海建国西路营业部和杭州解放路营业部对杭州恒生网络技术服务有限责任公司 HOMS系统(以下简称HOMS系统)开放专线接入,其中第一条专线于2014年3月由零售与网络金融部、信息技术管理部、合规与风险管理总部平行审核后接入上线。第二条专线于2015年2月由零售与网络金融部、合规与风险管理总部、信息技术管理部平行审核后接入上线。对于上述外部接入第三方交易终端软件,海通证券未进行软件认证许可,未对外部系统接入实施有效管理,对相关客户身份情况缺乏了解。

截止调查日,海通证券客户中,有120个使用HOMS系统接入的主账户。对上述客户,海通证券未按要求采集客户交易终端信息,未能确保客户交易终端信息的真实性、准确性、完整性、一致性、可溯性,未采取可靠措施采集、记录与客户身份识别有关的信息。

海通证券通过添加白名单方式允许客户使用HOMS系统进行交易,缺少实质性审核。在客户回访方面,海通证券员然对客户进行了回访,但在回访时没有对客户交易委托电话、IP、MAC等与客户进行全面核对。使用HOMS系统进行分仓交易的账户由于操作子账户多,主账户的交易较为频繁、异常,明显不同于其他普通账户,但海通证券没有对该等账户重点关注,缺少有效监督。海通证券在未采集、上述客户身份识别信息的情况下,未实施有效的了解客户身份的回访、检查等程序。

综上,海通证券未按照《证券登记结算管理办法》第二十四条、《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条、《中国证监会关于加强证券经纪业务管理的规定》第三条第(四)项、《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户的身份信息进行审查和了解,违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定,构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第(四)项所述的行为,获利2865.3万元。时任海通证券零售与网络金融部总经理丁学清及第二海、信息技术管理部总经理沈云明、合规与风险管理总部副总经理未世浩是直接责任的主管人员,宁波百丈东路营业部前台负责人高宏杰、宁波百丈东路营业部总经理方贤明、杭州解放路营业部副总经理汪峰为其他直接责任人员。根据当事人违法行为的事实、性质、情节和社会危害程度,依据《证券公司监督管理条例》第八十四条的规定,我会拟决定:一、对海通证券责令改正,给予警告,没收违法所得28,653,000元,并处以85,959,000元罚款;二、对丁学清给予警告,并处以10万元罚款;三、对邹二海给予警告,并处以10万元罚款;四、对高宏杰给予警告,并处以10万元罚款;五、对汪峰给予警告,并处以5万元罚款;六、对方贤明给予警告,并处以5万元罚款;七、对沈云明给予警告,并处以5万元罚款;八、对未世浩给予警告,并处以5万元罚款。

华泰证券

2015年9月10日,公司收到中国证券监督管理委员会《行政处罚事先告知书》(处罚字[2015]72号),华泰证券涉嫌违法违规的事实如下:2013年7月29日,华泰证券威宁路营业部应客户上海朝兴置业有限公司(以下简称朝兴置业)的要求,与杭州恒生网络技术服务有限公司(以下简称恒生网络)共同测试HOMS系统接入华泰证券软件系统。系统连通