融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2016年第1号)

重要提示

融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证监会2015年10月14日证监许可[2015]2290号文准予募集注册。本基金基金合同于2015年11月17日正式生效。

投资有风险,投资人购买本基金时应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金更新招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为2016年5月17日,有关财务数据截止日为2016年3月31日(财务数据未经审计)。

一、基金合同生效日期

2015年11月17日

二、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:融通基金管理有限公司

注册地址:深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层

设立日期:2001年5月22日

法定代表人:高峰

办公地址:深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层

电话:(0755)26948070

联系人:刘宏

目前公司股东及出资比例为:新时代证券股份有限公司60%、日兴资产管理有限公司(Nikko Asset Management Co.,Ltd.)40%。

(二)主要人员情况

1、现任董事情况

董事长高峰先生,金融学博士,现任融通基金管理有限公司董事长。历任大鹏证券投行部高级经理、业务董事,平安证券投行部副总经理,北京远略投资咨询有限公司总经理,深圳新华富时资产管理有限公司总经理。2015年7月起至今,任公司董事长。

独立董事杜婕女士,经济学博士,民进会员,注册会计师,现任吉林大学经济学院教授。历任电力部第一工程局一处主管会计,吉林大学教师、讲师、教授。2011年1月至今,任公司独立董事。

独立董事田利辉先生,金融学博士后、执业律师,现任南开大学金融发展研究院教授。历任密歇根大学戴维德森研究所博士后研究员、北京大学光华管理学院副教授、南开大学金融发展研究院教授。2011年1月至今,任公司独立董事。

独立董事施天涛先生,法学博士,现任清华大学法学院教授、法学院副院长、博士研究生导师、中国证券法学研究会和中国保险法学研究会副会长。2012年1月至今,任公司独立董事。

董事马金声先生,高级经济师,现任新时代证券股份有限公司名誉董事长。历任中国人民银行办公厅副主任、主任,金银管理司司长,中国农业发展银行副行长,国泰君安证券股份有限公司党委书记兼副董事长,华林证券有限责任公司党委书记。2007年1月至今,任公司董事。

董事黄庆华先生,工科学士,现任上海宜利实业有限公司总裁助理兼投资管理部总经理。历任上海宜利实业有限公司投资管理部经理助理、新时代证券股份有限公司经纪事业部综合管理处主管。2015年2月至今,任公司董事。

董事David Semaya(薛迈雅)先生,教育学硕士,现任日兴资产管理有限公司执行董事长,三井住友信托银行有限公司顾问。历任日本美林副总,纽约美林总监,美林投资管理有限公司首席运营官、代表董事和副总、代表董事和主席,巴克莱全球投资者日本信托银行有限公司总裁及首席执行官,巴克莱全球投资者(英国)首席执行官,巴克莱集团、财富管理(英国)董事及总经理。2015年6月至今,任公司董事。

董事AllenYan(颜锡廉)先生,工商管理硕士,现任融通基金管理有限公司常务副总经理兼融通国际资产管理有限公司总经理。历任富达投资公司(美国波士顿)分析员、富达投资公司(日本东京)经理、日兴资产管理有限公司部长。2015年6月至今,任公司董事。

董事孟朝霞女士,经济学硕士,现任融通基金管理有限公司总经理。历任新华人寿保险股份有限公司企业年金管理中心总经理、泰康养老保险股份有限公司副总经理、富国基金管理有限公司副总经理。2015年2月至今,任公司董事。

2、现任监事情况

监事刘宇先生,金融学硕士、计算机科学硕士,现任公司监察稽核部总经理。历任国信证券股份有限公司投资银行部项目助理、安永会计师事务所高级审计员、景顺长城基金管理有限公司法律监察稽核部副总监。2015年8月起至今,任公司监事。

3、公司高级管理人员情况

董事长高峰先生,简历同上。

总经理孟朝霞女士,经济学硕士。历任新华人寿保险股份有限公司企业年金管理中心总经理、泰康养老保险股份有限公司副总经理、富国基金管理有限公司副总经理。2014年9月至今,任公司总经理。

常务副总经理Allen Yan(颜锡廉)先生,工商管理硕士。历任富达投资公司(美国波士顿)分析员、富达投资公司(日本东京)经理、日兴资产管理有限公司部长。2011年3月至今,任公司常务副总经理。

副总经理刘晓玲女士,金融学学士。历任博时基金管理有限公司零售业务部渠道总监,富国基金管理有限公司零售业务部负责人,泰康资产管理有限责任公司公募事业部市场总监。2015年9月起至今,任公司副总经理。

督察长涂卫东先生,法学硕士。历任国务院法制办公室(原国务院法制局)财金司公务员,曾在中国证监会法律部和基金监管部工作,曾是中国证监会公职律师。2011年3月至今,任公司督察长。

4、基金经理

(1)现任基金经理情况

余志勇先生,武汉大学金融学硕士、工商管理学学士,15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策划部副总监。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,2015年2月25日起至今任"融通通泽灵活配置混合基金"基金经理,2015年3月17日起至今任"融通通泰保本混合型证券投资基金"基金经理,2015年6月15日起至今任"融通通鑫灵活配置混合型证券投资基金"基金经理,2015年11月17日起至今任"融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金"基金经理。

5、投资决策委员会成员

公司公募基金投资决策委员会成员:投资总监商小虎先生,研究策划部总经理、基金经理邹曦先生,权益投资部总经理、基金经理刘格菘先生,基金交易部总经理谭奕舟先生,风险管理部总经理马洪元先生。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金托管人

(一)基金托管人基本情况

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)

住所:北京市西城区金融大街25号

办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人:王洪章

成立时间:2004年09月17日

组织形式:股份有限公司

注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间:持续经营

基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号

联系人:田 青

联系电话:(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月,是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行,总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939),于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2015年末,本集团资产总额18.35万亿元,较上年增长9.59%;客户贷款和垫款总额10.49万亿元,增长10.67%;客户存款总额13.67万亿元,增长5.96%。净利润2,289亿元,增长0.28%;营业收入6,052亿元,增长6.09%,其中,利息净收入增长4.65%,手续费及佣金净收入增长4.62%。平均资产回报率1.30%,加权平均净资产收益率17.27%,成本收入比26.98%,资本充足率15.39%,主要财务指标领先同业。

物理与电子渠道协同发展。营业网点"三综合"建设取得新进展,综合性网点数量达1.45万个,综合营销团队2.15万个,综合柜员占比达到88%。启动深圳等8家分行物理渠道全面转型创新试点,智慧网点、旗舰型、综合型和轻型网点建设有序推进。电子银行主渠道作用进一步凸显,电子银行和自助渠道账务性交易量占比达95.58%,较上年提升7.55个百分点;同时推广账号支付、手机支付、跨行付、龙卡云支付、快捷付等五种在线支付方式,成功实现绝大多数主要快捷支付业务的全行集中处理。

转型业务快速增长。信用卡累计发卡量8,074万张,消费交易额2.22万亿元,多项核心指标继续保持同业领先。金融资产1,000万以上的私人银行客户数量增长23.08%,客户金融资产总量增长32.94%。非金融企业债务融资工具累计承销5,316亿元,承销额市场领先。资产托管业务规模7.17万亿元,增长67.36%;托管证券投资基金数量和新增只数均为市场第一。人民币国际清算网络建设再获突破,继伦敦之后,再获任瑞士、智利人民币清算行资格;上海自贸区、新疆霍尔果斯特殊经济区主要业务指标居同业首位。

2015年,本集团先后获得国内外各类荣誉总计122项,并独家荣获美国《环球金融》杂志"中国最佳银行"、香港《财资》杂志"中国最佳银行"及香港《企业财资》杂志"中国最佳银行"等大奖。本集团在英国《银行家》杂志2015年"世界银行品牌1000强"中,以一级资本总额位列全球第二;在美国《福布斯》杂志2015年度全球企业2000强中位列第二。

中国建设银行总行设资产托管业务部,下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室,在上海设有投资托管服务上海备份中心,共有员工220余人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

(二)主要人员情况

赵观甫,资产托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作,并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务,长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室,长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部,并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务,长期从事信贷业务和集团客户业务等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行会计部,长期从事托管业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

(三)基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持"以客户为中心"的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2016年一季度末,中国建设银行已托管584只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至今连续六年被国际权威杂志《全球托管人》评为"中国最佳托管银行"。

四、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构情况

(1)融通基金管理有限公司机构理财部机构销售及服务深圳小组

办公地址:深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14 层

邮政编码:518053

联系人:陈思辰

电话:(0755)26948034

客户服务中心电话:400-883-8088(免长途通话费用)、(0755)26948088

(2)融通基金管理有限公司机构理财部机构销售及服务北京小组

办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座1241-1243单元

邮政编码:100140

联系人:魏艳薇

电话:(010)66190989

(3)融通基金管理有限公司机构理财部机构销售及服务上海小组

办公地址:上海市世纪大道8号国金中心汇丰银行大楼6楼601-602

邮政编码:200120

联系人:杨雁

联系电话:(021)38424950

(4)融通基金管理有限公司网上直销

办公地址:深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层

邮政编码:518053

联系人:殷洁

联系电话:(0755)269478562

2、基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构销售本基金,并及时公告。

(二)登记机构

名称:融通基金管理有限公司

办公地址:深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层

设立日期:2001年5月22日

法定代表人:高峰

电话:0755-26948075

联系人:杜嘉

(三)律师事务所

名称:上海市通力律师事务所

住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人:俞卫锋

经办律师:安冬、陆奇

电话:021-31358666

传真:021-31358600

联系人:安冬

(四)会计师事务所

会计师事务所名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

执行事务合伙人:李丹

电话:021-23238888

传真:021-23238800

联系人:俞伟敏

经办注册会计师:陈玲、俞伟敏

五、基金的名称

融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金。

六、基金的类型

契约型开放式。

七、基金的投资目标

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。

八、基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会批准发行上市的股票)、固定收益类资产(国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、资产支持证券、质押及买断式债券回购、银行存款及现金等)、衍生工具(权证、股指期货等)以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:

股票资产占基金资产的0%-95%,其余资产投资于债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具;基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%;每个交易日日终在扣除股指期货需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

九、基金的投资策略

1、大类资产配置策略

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。

在资产配置中,本基金主要考虑宏观经济指标,包括PMI水平、GDP增长率、M2增长率及趋势、PPI、CPI、利率水平与变化趋势、宏观经济政策等,来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向。

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。

2、股票投资策略

本基金结合定量和定性分析,通过对上市公司基本面状况分析,财务分析和股票估值分析的三层分析来逐级优选股票,在确定优质备选行业的基础上,发掘技术领先、竞争壁垒明显、具有长期可持续增长模式并且估值水平相对合理的优质上市公司进行组合式投资。

(1)上市公司基本面状况分析

具体分析而言,行业地位方面,选择在产业链上有稳固地位,行业壁垒高的上市公司;技术研发方面,通过对公司产品和研发团队的判断,选择有竞争优势,符合具备创新技术的公司;公司治理结构方面,选择管理层优秀,公司治理结构规范,有清晰的竞争战略,人员激励到位的公司。

(2)上市公司财务状况分析

本基金的财务分析偏重于公司的成长性分析。本基金通过对财务报告提供的信息,系统性的分析企业的经营情况,重点关注上市公司的盈利能力、经营效率,业务成长能力、持续经营能力、资金杠杆水平以及现金流管理水平,对公司做出综合分析和评价,预测公司未来的盈利能力,挑选出有优良财务状况的上市公司股票。

(3)上市公司股票估值分析

本基金将采用多种指标对股票进行估值分析。包括盈利性指标(市盈率、市销率等)、增长性指标(销售收入增长率,净利润增长率等)以及其他指标对公司股票进行多方面的评估。本基金同时将公司市值与行业竞争对手,未来市场成长空间进行多维度对比。基于以上的综合评估,确定本基金的重点备选投资对象,从中选择最具有投资吸引力的股票构建投资组合。

3、债券投资策略

在债券投资上,本基金贯彻"自上而下"的策略,采用三级资产配置的流程。

(1)久期管理

根据对利率趋势的判断以及收益率曲线的变动趋势确定各类债券组合的组合久期策略。

(2)类属配置与组合优化

根据品种特点及市场特征,将市场划分为企业债、银行间国债、银行间金融债、可转换债券、央行票据、交易所国债六个子市场。在几个市场之间的相对风险、收益(等价税后收益)进行综合分析后确定各类别债券资产的配置。具体而言考虑市场的流动性和容量、市场的信用状况、各市场的风险收益水平、税收选择等因素。

(3)通过因素分析决定个券选择

从收益率曲线偏离度、绝对和相对价值分析、信用分析、公司研究等角度精选有投资价值的投资品种。本基金财产力求通过绝对和相对定价模型对市场上所有债券品种进行投资价值评估,从中选择暂时被市场低估或估值合理的投资品种。

本基金重点关注:期限相同或相近品种中,相对收益率水平较高的券种;到期期限、收益率水平相近的品种中,具有良好流动性的券种;同等到期期限和收益率水平的品种,优先选择高票息券种;预期流动性将得到较大改善的券种;公司成长性良好的可转债品种;转债条款优厚、防守性能较好的可转债品种。

4、资产支持证券投资策略

本基金通过对资产支持证券资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响,谨慎投资资产支持证券。

5、中小企业私募债投资策略

与传统的信用债券相比,中小企业私募债券由于以非公开方式发行和转让,普遍具有高风险和高收益的显著特点。本基金将运用基本面研究,结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量,选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。具体为:①研究债券发行人的公司背景、产业发展趋势、行业政策、盈利状况、竞争地位、治理结构等基本面信息,分析企业的长期运作风险;②运用财务评价体系对债券发行人的资产流动性、盈利能力、偿债能力、成长能力、现金流水平等方面进行综合评价,评估发行人财务风险;③利用历史数据、市场价格以及资产质量等信息,估算私募债券发行人的违约率及违约损失率;④考察债券发行人的增信措施,如担保、抵押、质押、银行授信、偿债基金、有序偿债安排等;⑤综合上述分析结果,确定信用利差的合理水平,利用市场的相对失衡,选择具有投资价值的品种进行投资。

6、权证投资策略

本基金将权证看作是辅助性投资工具,其投资原则为优化基金资产的风险收益特征。本基金将在权证理论定价模型的基础上,综合考虑权证标的证券的基本面趋势、权证的市场供求关系以及交易制度设计等多种因素,对权证进行合理定价。本基金权证主要投资策略为低成本避险和合理杠杆操作。

7、金融衍生工具投资策略

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。

十、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×50%+中债综合全价(总值)指数收益率×50%

选择该业绩比较基准的理由主要如下:

1、沪深300指数对股票市场具有较强的代表性,适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。

2、中债综合全价(总值)指数能够较好的反映债券市场变动的全貌,适合作为本基金债券投资的比较基准。

如果指数编制单位停止计算编制这些指数或更改指数名称,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩基准时,经与基金托管人协商一致,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,而无须召开基金份额持有人大会。

十一、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。

十二、基金投资组合报告

本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5月27日复核了本报告中的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。

本投资组合报告所载数据截至2016年3月31日。本报告中所列财务数据未经审计。

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	72,882,291.61	4.39
	其中:股票	72,882,291.61	4.39
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	877,412,000.00	52.90
	其中:债券	877,412,000.00	52.90
	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	250,001,095.00	15.07
	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	447,021,665.18	26.95
8	其他资产	11,445,418.98	0.69
9	合计	1,658,762,470.77	100.00

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	3,645,000.00	0.23
C	制造业	51,304,838.30	3.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	10,004,953.31	0.63
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	7,927,500.00	0.50
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	72,882,291.61	4.55

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	000709	河钢股份	3,500,000	10,675,000.00	0.67
2	600491	龙元建设	1,499,993	10,004,953.31	0.63
3	002385	大北农	818,100	9,653,580.00	0.60
4	600439	瑞贝卡	1,800,000	9,360,000.00	0.58
5	600782	新钢股份	1,617,600	8,379,168.00	0.52
6	002501	利源精制	500,000	5,170,000.00	0.32
7	600048	保利地产	500,000	4,640,000.00	0.29
8	002037	久联发展	250,000	4,267,500.00	0.27
9	601699	潞安环能	500,000	3,645,000.00	0.23
10	600076	康欣新材	300,000	3,375,000.00	0.21

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	185,870,000.00	11.62
	其中:政策性金融债	185,870,000.00	11.62
4	企业债券	241,442,000.00	15.09
5	企业短期融资券	340,364,000.00	21.27
6	中期票据	109,736,000.00	6.86
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	877,412,000.00	54.83

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	011599945	15中油股SCP006	1,500,000	150,315,000.00	9.39
2	011699175	16华电SCP002	1,500,000	150,045,000.00	9.38
3	101652003	16南电MTN001	1,100,000	109,736,000.00	6.86
4	150409	15农发09	1,000,000	102,550,000.00	6.41
5	136173	16龙源01	1,000,000	100,560,000.00	6.28

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。

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。

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。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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。

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。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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。

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。

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。

11、投资组合报告附注

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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

2015年4月17日,潍坊北大青鸟华光科技股份有限公司(后更名为"康欣新材料股份有限公司")收到证监会下发的【2015】7号《行政处罚决定书》,青鸟华光违反了《证券法》第六十三条、第六十六条(二)项、第(五)项关于信息披露的规定,构成《证券法》第一百九十三条所述的信息披露违法行为。根据当事人违法行为的事实、性质、情节及社会危害程度,依据《证券法》第一百九十三条第一款的规定,证监会决定对青鸟华光给予警告,责令改正,并处以60万元罚款。

康欣新材已经完成资产交割,管理层也已更换,成为全新公司。基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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。

11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	172,699.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,272,719.03
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,445,418.98

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。

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	601699	潞安环能	3,645,000.00	0.23	重大事项停牌

十三、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。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。

本基金合同生效日为2015年11月17日,基金业绩截止日为2016年3月31日。基金合同生效以来本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表如下:

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	0.20%	0.12%	-6.57%	1.22%	6.77%	-1.10%
自基金合同生效至今	-0.40%	0.12%	-6.15%	1.09%	5.75%	-0.97%

十四、基金的费用与税收

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;

4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

5、基金份额持有人大会费用;

6、基金的证券/期货交易费用;

7、基金的银行汇划费用;

8、基金的相关账户的开户及维护费用;

9、按照国家有关规定和基金合同约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.2%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.2%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

上述"一、基金费用的种类中第3-9项费用",根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、基金合同生效前的相关费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《基金法》、《运作管理办法》、《销售管理办法》、《信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求,对本基金管理人于2015年11月13日刊登的本基金招募说明书进行了更新,主要更新内容如下:

1、在"重要提示"部分,明确了更新招募说明书内容的截止日期、有关财务数据和基金业绩的截止日期及基金合同生效日期。

2、在"三、基金管理人"部分,根据最新资料更新了基金管理人概况、主要人员情况;

3、在"四、基金托管人"部分,更新了相关信息;

4、在"五、相关服务机构"部分,更新了销售机构的相关信息;

5、在"六、基金的募集"部分,更新了募集及验资的相关信息;

6、在"七、基金合同的生效"部分,更新了相关信息;

7、在"八、基金份额的申购、赎回与转换"部分,更新了相关信息;

8、在"九、基金的投资"部分,对本基金2016年第1季度报告中的投资组合数据进行了列示;

9、在"十、基金的业绩"部分,按规定要求对基金的投资业绩数据进行了列示,已经基金托管人复核;

10、在"十四、基金的费用与税收"部分,根据基金持有人大会召开的结果,于2016年2月26日更新了管理费率及托管费率;

11、在"二十一、基金份额持有人的服务"部分,根据最新资料更新了相关信息;

12、在"二十二、其他应披露事项"部分,对本报告期内的公告信息进行了列示。

融通基金管理有限公司

2016年6月23日

证券代码:002700 证券简称:新疆浩源 公告编号:2016-024

新疆浩源天然气股份有限公司控股股东股份解除质押及被质押的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

公司近日接到控股股东周举东先生函告,获悉周举东先生将持有本公司的股份进行了解除质押和被质押,具体事项如下:

一、股东股份质押(解除质押、冻结、拍卖或设定信托)的基本情况

1. 股东股份解除质押基本情况

2016年6月20日,周举东先生将前期与招商证券股份有限公司股票质押回购交易业务中的三笔办理了部分解质押手续(情况如下表所示)。部分解质押后,剩余质押股份数量累计108,459,300股。

账户	账户	账户		账户		剩余质押股份数量(股)
		质押股份数量(股)	质押时间	解质押股份数量(股)	解质押时间	
周举东	0120746125	20,600,000	2014/11/26	5,605,700	2016/6/20	14,994,300
周举东	0120746125	16,480,000	2015/4/29			16,480,000
周举东	0120746125	5,200,000	2015/9/8			5,200,000
周举东	0120746125	33,000,000	2015/12/18	3,471,800	2016/6/20	29,528,200
周举东	0120746125	30,000,000	2015/12/18	2,743,200	2016/6/20	27,256,800
周举东	0120746125	15,000,000	2015/12/18			15,000,000
合计:		120,280,000		11,820,700		108,459,300

2. 股东股份被质押基本情况

2016年6月21日,周举东先生办理两笔股票质押回购交易业务(情况如下表所示)。

股东名称	是否为第一大股东及一致行动人	质押股数(股)	质押开始日期(逐笔列示)	质押到期日	质权人	本次质押占其所持股份比例	用途
周举东	是	9,085,500	2016/6/21	2017/11/25	招商证券股份有限公司	7.5471%	股票质押初始交易
周举东	是	2,839,200	2016/6/21	2017/11/25	招商证券股份有限公司	2.3585%	股票质押初始交易
合计:		11,924,700				9.9056%	

3. 股东股份累计被质押的情况

截至公告披露日,控股股东周举东先直接持有公司股份120,384,000股,占公司总股本的28.50%;本次被质押股份11,924,700股,占公司总股本的2.82%;其所直接持有公司股份累计被质押120,384,000股,占公司总股本的28.50%。

二、备查文件

1. 股东股票质押交易业务对账单;

2. 中国证券登记结算有限责任公司股份冻结数据明细。

特此公告。

新疆浩源天然气股份有限公司

董事会

2016年6月22日

证券代码:002597 证券简称:金禾实业 公告编号:2016-060

安徽金禾实业股份有限公司第四届董事会第七次会议决议公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

安徽金禾实业股份有限公司(以下简称"公司")第四届董事会第七次会议于2016年6月15日向各位董事发出通知,并于2016年6月21日上午9:30以现场结合通讯方式在董事会办公室召开,会议由董事长主持召开,本次会议应参加表决的董事9人,实际参加表决的董事9人,符合《公司法》、《公司章程》的规定。会议审议并通过了以下议案:

一、审议通过《关于全资子公司滁州金丰投资有限责任公司向滁州皖东农村商业银行长江支行申请12000万元贷款授信额度的议案》。

公司于2016年4月12日召开了第四届董事会第四次会议,会议审议通过了《关于出让全资子公司滁州金丰投资有限责任公司股权的议案》,同意将滁州金丰投资有限责任公司(以下简称"金丰投资")100%股权以人民币15238万元转让给滁州宇达物业开发有限公司(以下简称"滁州宇达")。详见公司与2016年4月14日在巨潮资讯网披露的《关于出让全资子公司100%股权的公告》。

截止目前,滁州宇达已按《股权转让协议》向公司支付了6238万元转让款项,金丰投资100%股权尚未过户至滁州宇达名下。

为保证金丰投资土地项目的顺利开发,应滁州宇达的要求,公司同意金丰投资向滁州皖东农村商业银行长江支行申请12,000万元授信额度。

公司不为此次授信申请提供其他任何形式的担保,且本次授信申请顺利与否不影响《股权转让协议》的履行。

表决结果:同意9票,反对0票,弃权0票。

特此公告!

安徽金禾实业股份有限公司

董事会

二〇一六年六月二十二日

证券代码:002597 证券简称:金禾实业 公告编号:2016-061

安徽金禾实业股份有限公司关于全资子公司完成股权转让工商变更登记的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

为进一步完善公司治理结构,优化公司产业布局和资源配置,专注于公司主营业务,降低公司生产管理成本,综合考虑长期战略发展目标,安徽金禾实业股份有限公司(以下简称"公司")于2016年6月1日召开第四届董事会第六次会议,会议审议通过《关于出让部分全资子公司100%股权的议案》,公司将出让全资子公司来安县金利化工有限责任公司(以下简称"金利化工")、来安立鑫港口经营物流有限责任公司(以下简称"立鑫港口")100%股权。具体内容详见公司于2016年6月2日在指定信息披露媒体巨潮资讯网、《证券日报》、《证券时报》、《上海证券报》上披露的《关于出让部分全资子公司100%股权的公告》(公告编号:2016-053)。

近日,公司已与受让方签署了股权转让协议,并完成了股权转让工商变更登记等相应的手续。本次股权转让完成后,金利化工和立鑫港口将不再纳入公司年报的合并报表范围内。

特此公告!

备查文件:

1、金利化工股权转让协议;

2、立鑫港口股权转让协议。

安徽金禾实业股份有限公司

董事会

二〇一六年六月二十二日

证券代码:600856 证券简称:中天能源 公告编号:临2016-061

长春中天能源股份有限公司关于获得加拿大联邦政府工业部投资审查局回复公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

公司通过全资子公司青岛中天能源股份有限公司受让嘉兴天际泓盛能源投资合伙企业(有限合伙)有的青岛中天石油投资有限公司(以下简称"中天石油投资")49.74%股权并履行尚未完成的出资义务从而获得其控股权,获得控股权后,公司将通过中天石油投资的海外全资孙公司Calgary Sinoenergy Investment Corporation(卡尔加里中天石油投资有限公司)最终现金收购加拿大油气田公司Long Run Exploration Ltd(以下简称"本次重大资产重组")。本次重大资产重组已经公司第八届董事会第二十四次会议及公司2016年第二次临时股东大会审议通过,并于以披露。

根据《加拿大投资法》规定,本次重大资产重组需获得加拿大联邦政府工业部投资审查局关于加拿大投资法案准许。

2016年6月22日,长春中天能源股份有限公司收到加拿大联邦政府工业部投资审查局出具的《关于卡尔加里中天石油投资有限公司收购加拿大Long Run勘探有限公司的控制权回复》(文件编码:210-C2717/1),回复如下:

已完成对贵公司申请的审核,相信贵公司的投资将为加拿大带来净收益。根据《加拿大投资法》,本信函批准贵公司的投资申请。

公司将根据重大资产重组相关协议约定积极推进后续相关工作,并及时履行信息披露义务。

特此公告。

长春中天能源股份有限公司

2016年6月23日

证券代码:600661 股票简称:新南洋 编号:临2016-023

上海新南洋股份有限公司关于收到《中国证监会行政许可项目审查反馈意见通知书》的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

上海新南洋股份有限公司(以下简称"公司")近日收到中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")出具的《中国证监会行政许可项目审查反馈意见通知书》(161196号)。中国证监会依法对公司提交的《上海新南洋股份有限公司非公开发行申请文件》进行了审查,现需要公司就有关问题作出书面说明和解释,并在30日内向中国证监会行政许可受理部门提交书面回复意见。

公司与相关中介机构将按照上述通知书的要求,在规定的期限内及时将有关材料报送中国证监会行政许可受理部门。

公司本次非公开发行股票事项尚需获得中国证监会的核准,存在一定的不确定性。公司将根据中国证监会对该事项的审批进展情况,及时履行信息披露义务。

敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

上海新南洋股份有限公司

董事会

二〇一六年六月二十二日