# 融通成长30灵活配置混合型证券投资基金

## 2017 第四季度 报告

2017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：2018年1月18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2017年10月1日起至2017年12月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 融通成长30灵活配置混合 |
| 交易代码 | 002252 |
| 前端交易代码 | 002252 |
| 后端交易代码 | 002253 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年12月11日 |
| 报告期末基金份额总额 | 209,072,429.73份 |
| 投资目标 | 本基金通过精选个股和集中投资，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的持续稳健增值。 |
| 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 | 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(2017年10月1日-2017年12月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 10,741,823.33 |
| 2.本期利润 | -6,017,563.44 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0259 |
| 4.期末基金资产净值 | 213,453,302.68 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.021 |

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。

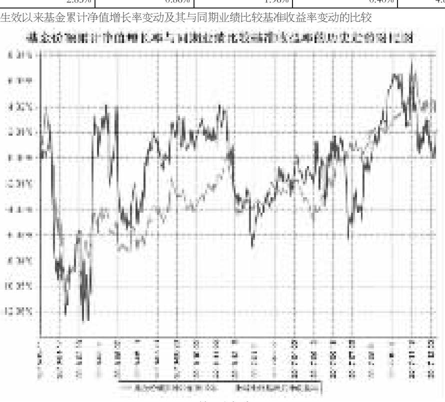
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | -2.85% | 0.86% | 1.96% | 0.40% | -4.81% | 0.46% |

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 | | |
| 付伟琦 | 本基金的基金经理、研究部总经理。 | 2017年2月18日 | - | 7 | 付伟琦先生，清华大学物理学博士、西安交通大学物理学学士，7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经理。历任中信证券公司行业研究员、瑞银证券公司行业研究员。2014年11月加入融通基金管理有限公司，现任融通新能源灵活配置混合、融通内需驱动混合、融通成长30灵活配置混合基金的基金经理。 |

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

我们认为，宏观经济将在较长时间内稳定。从上市公司三季报看，与宏观经济关联度较高的部分公司业绩出现向上加速的迹象。我们重点选择了一批成长空间较大，同时又受益于宏观回暖的高端消费类成长股。

经过2017年的分化，我们认为绩优成长股估值普遍下降至20-25倍，而在2017年实现业绩与估值双升的偏白马类公司，估值已经较高，风险收益比下降。我们更看好内生增长强劲，同时估值已经合理偏低的成长类公司。

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1.021元；本报告期基金份额净值增长率为-2.85%，业绩比较基准收益率为1.96%。

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 | 191,052,618.62 | 87.51 |
| | 其中：股票 | 191,052,618.62 | 87.51 |
| 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 | 26,205,008.01 | 12.00 |
| 8 | 其他资产 | 1,067,343.00 | 0.49 |
| 9 | 合计 | 218,324,969.63 | 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 | 78,681,833.31 | 36.86 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 16,143.20 | 0.01 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 35,190,552.51 | 16.49 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 17,957.94 | 0.01 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 23,533,380.30 | 11.03 |
| J | 金融业 | 15,604,948.72 | 7.31 |
| K | 房地产业 | 12,481,715.00 | 5.85 |
| 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 | 32,323.20 | 0.02 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 8,752,199.04 | 4.10 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 16,741,565.40 | 7.84 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 191,052,618.62 | 89.51 |

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 | 002640 | 跨境通 | 1,097,816 | 21,012,198.24 | 9.84 |
| 2 | 002832 | 比音勒芬 | 292,100 | 17,581,499.00 | 8.24 |
| 3 | 300365 | 恒华科技 | 545,673 | 17,270,550.45 | 8.09 |
| 4 | 300144 | 宋城演艺 | 897,190 | 16,741,565.40 | 7.84 |
| 5 | 603556 | 海兴电力 | 381,065 | 13,870,766.00 | 6.50 |
| 6 | 603328 | 依顿电子 | 852,255 | 12,229,859.25 | 5.73 |
| 7 | 603900 | 莱绅通灵 | 377,173 | 10,934,245.27 | 5.12 |
| 8 | 603737 | 三棵树 | 139,785 | 9,909,358.65 | 4.64 |
| 9 | 603308 | 应流股份 | 554,000 | 8,803,060.00 | 4.12 |
| 10 | 002044 | 美年健康 | 400,192 | 8,752,199.04 | 4.10 |

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

本基金本报告期末持有股指期货。

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。

依顿电子：

2017年1月5日，广东依顿电子科技股份有限公司公告收到中山市环境保护局（以下简称"中山市环保局"）《行政处罚告知书》（中环罚告字[2016]第239号），相关情况如下：中山市环保局于2016年5月26日对公司排放口外排的废水进行执法性采样监测。监测结果显示，公司排放的废水中总磷、总氮浓度为1.38mg/L、31.4mg/L，分别超过了公司持有的《广东省污染物排放许可证》中规定的排放限值0.38倍、0.57倍。

公司以上行为违反了《广东省环境保护条例》第二十一条第一款关于按照排污许可证规定排污的规定。中山市环保局依据《广东省环境保护条例》第六十六条第一款的规定：拟对公司罚款人民币十四万元。

本管理人认为，以上处罚对依顿电子经营影响较小，并且依顿电子已经改正。基于依顿电子业务的发展，本管理人认为依顿电子的业绩有较好的成长性，同时估值处于较低的水平，可以继续持有。

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 | 230,711.47 |
| 2 | 应收证券清算款 | 814,434.73 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 7,069.51 |
| 5 | 应收申购款 | 15,127.29 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,067,343.00 |

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

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 | 302,666,124.46 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 724,453.47 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 94,318,148.20 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 209,072,429.73 |

§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 影响投资者决策的其他重要信息

根据2016年12月25日财政部、国家税务总局联合下发的《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》（财税〔2016〕140号）、2017年1月10日财政部、国家税务总局联合下发的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税〔2017〕2号）及财政部2017年6月30日发布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税[2017]56号）的通知，现明确自2018年1月1日起，基金管理人运营公募基金及资管产品（以下简称"产品"）过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

自2018年1月1日（含）起，本基金管理人将对旗下存续及新增产品发生的增值税应税行为按照相关规定以及税务机关的要求计算和缴纳增值税税款及附加税费。前述税款及附加税费是产品管理、运作和处分过程中发生的，将由产品资产承担，从产品资产中提取缴纳，可能对产品收益水平有所影响，敬请广大投资者知悉。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

（一）《融通成长30灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
（二）《融通成长30灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
（三）《融通成长30灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
（四）中国证监会批准融通成长30灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
（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 www.rtfund.com 查询。

融通基金管理有限公司
2018年1月18日

# 融通通盈保本混合型证券投资基金

## 2017 第四季度 报告

2017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：2018年1月18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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 融通通盈保本混合 |
| 交易代码 | 002415 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016年3月15日 |
| 报告期末基金份额总额 | 629,324,549.56份 |
| 投资目标 | 通过固定收益类资产与权益类资产的动态配置和有效的组合管理，在确保保本周期到期时本金安全的基础上，力争实现基金资产的稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金采用时间不变性投资组合保险策略(TIPP，TimeInvariantPortfolioProtection)，通过量化技术动态调整资产配置比例，以达到保证本金安全的基本目标。 |
| 业绩比较基准 | 三年期银行定期存款税后收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金和非保本混合型基金。 |
| 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 |
| 基金保证人 | 深圳市高新投集团有限公司 |

§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(2017年10月1日-2017年12月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 6,576,254.47 |
| 2.本期利润 | 6,699,602.41 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0103 |
| 4.期末基金资产净值 | 658,491,633.91 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.046 |

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。

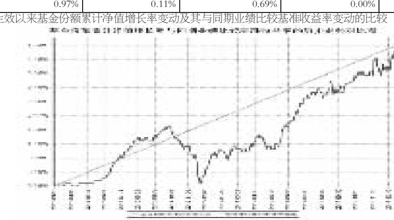
（2）本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | 0.97% | 0.11% | 0.69% | 0.00% | 0.28% | 0.11% |

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



§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 | | |
| 张一格 | 本基金的基金经理、固定收益投资总监 | 2016年3月15日 | - | 11 | 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)。11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，现任融通易支付货币、融通通盈保本、融通增裕债券、融通增祥债券、融通增丰债券、融通通瑞债券、融通通优债券、融通月月添利定期开放债券、融通通鑫灵活配置混合、融通新机遇灵活配置混合、融通通裕债券、融通收益增强债券基金的基金经理。 |

注：任免日期指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

2017年四季度，债券市场进一步下跌。首先，今年持续的去杠杆政策以及MPA考核的压力，导致跨年流动性十分紧张，推动了短端利率的上移。其次，经济表现出了非常强的韧性，信贷和社会融资总量几乎每月都超出市场预期，显示实体经济的融资需求旺盛。第三，新的监管规范不断出台，如资管新规征求意见稿、商业银行流动性管理办法等，调整的预期不断发酵。

股票市场方面，四季度沪深300指数上涨5.07%，创业板指下跌6.12%，继续延续结构性行情。食品饮料、家电等行业表现突出，建筑、传媒等行业表现较差。

本基金四季度在债券方面，配置上坚持了中短久期的思路，考虑到资金成本较高，继续降低杠杆水平。在权益方面，新增配的航空股以及持续持有的金融、建筑建材等股票为组合贡献了较为稳定的收益。

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1.046元；本报告期基金份额净值增长率为0.97%，业绩比较基准收益率为0.69%。

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 | 61,024,988.85 | 7.63 |
| | 其中：股票 | 61,024,988.85 | 7.63 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 669,090,999.00 | 83.68 |
| | 其中：债券 | 667,836,999.00 | 83.53 |
| | 资产支持证券 | 1,254,000.00 | 0.16 |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 52,998,275.00 | 6.63 |
| | 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 | 2,095,502.07 | 0.26 |
| 8 | 其他资产 | 14,346,191.15 | 1.79 |
| 9 | 合计 | 799,555,956.07 | 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 | 15,379,387.71 | 2.34 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 16,143.20 | 0.00 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 50,500.00 | 0.01 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 13,369,957.94 | 2.03 |
| 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 | 32,209,000.00 | 4.89 |
| 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 | 61,024,988.85 | 9.27 |

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 | 601288 | 农业银行 | 3,600,000 | 13,788,000.00 | 2.09 |
| 2 | 601398 | 工商银行 | 1,470,000 | 9,114,000.00 | 1.38 |
| 3 | 600887 | 伊利股份 | 230,000 | 7,403,700.00 | 1.12 |
| 4 | 601111 | 中国国航 | 600,000 | 7,392,000.00 | 1.12 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 100,000 | 6,998,000.00 | 1.06 |
| 6 | 600029 | 南方航空 | 500,000 | 5,960,000.00 | 0.91 |
| 7 | 601766 | 中国中车 | 300,000 | 3,633,000.00 | 0.55 |
| 8 | 601600 | 中国铝业 | 200,000 | 1,618,000.00 | 0.25 |
| 9 | 603833 | 欧派家居 | 13,000 | 1,534,650.00 | 0.23 |
| 10 | 601336 | 新华保险 | 20,000 | 1,404,000.00 | 0.21 |

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 | 89,961,000.00 | 13.66 |
| | 其中：政策性金融债 | 39,956,000.00 | 6.07 |
| 4 | 企业债券 | 248,830,647.30 | 37.79 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 156,788,200.00 | 23.81 |
| 7 | 可转债(可交换债) | 475,151.70 | 0.07 |
| 8 | 同业存单 | 171,782,000.00 | 26.09 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 667,836,999.00 | 101.42 |

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 | 091501001 | 15中国信达债01 | 500,000 | 50,005,000.00 | 7.59 |
| 2 | 111709236 | 17浦发银行CD236 | 500,000 | 47,610,000.00 | 7.23 |
| 3 | 112419 | 16河钢01 | 400,000 | 39,612,000.00 | 6.02 |
| 4 | 136510 | 16华电01 | 400,000 | 38,704,000.00 | 5.88 |
| 5 | 101554024 | 15金地MTN001 | 300,000 | 30,123,000.00 | 4.57 |

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

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量(份) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 1689116 | 16中誉1优先 | 200,000 | 1,254,000.00 | 0.19 |

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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用其他相关金融工具对投资组合进行管理。

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

为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。

在国债期货投资时，本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约，其次，考虑国债期货各合约的流动性情况，最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理的目标。

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 | 41,290.78 |
| 2 | 应收证券清算款 | 946,919.90 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 13,357,980.47 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 14,346,191.15 |

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 | 601600 | 中国铝业 | 1,618,000.00 | 0.25 | 重大事项停牌 |

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 684,799,091.06 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 64,655.22 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 55,539,196.72 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 629,324,549.56 |

§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 影响投资者决策的其他重要信息

根据2016年12月25日财政部、国家税务总局联合下发的《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》（财税〔2016〕140号）、2017年1月10日财政部、国家税务总局联合下发的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税〔2017〕2号）及财政部2017年6月30日发布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税[2017]56号）的通知，现明确自2018年1月1日起，基金管理人运营公募基金及资管产品（以下简称"产品"）过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

自2018年1月1日（含）起，本基金管理人将对旗下存续及新增产品发生的增值税应税行为按照相关规定以及税务机关的要求计算和缴纳增值税税款及附加税费。前述税款及附加税费是产品管理、运作和处分过程中发生的，将由产品资产承担，从产品资产中提取缴纳，可能对产品收益水平有所影响，敬请广大投资者知悉。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

（一）中国证监会批融通通盈保本混合型证券投资基金设立的文件
（二）《融通通盈保本混合型证券投资基金基金合同》
（三）《融通通盈保本混合型证券投资基金托管协议》
（四）《融通通盈保本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。

# 融通创业板指数增强型证券投资基金

## 2017 第四季度 报告

2017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：2018年1月18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2017年10月1日起至2017年12月31日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 融通创业板指数 | |
| 交易代码 | 161613 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2012年4月6日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 583,674,742.93份 | |
| 投资目标 | 本基金在基金合同规定的范围内，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，结合增强收益的主动投资，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度控制在0.5%以内、年化跟踪误差控制在7.75%以内、基金总体投资业绩超越创业板指数的表现。 | |
| 投资策略 | 本基金为增强型指数基金，对指数投资部分，采用完全复制指数的投资策略，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化进行相应调整。本基金对主动投资部分采取积极配置策略，力争在跟踪误差控制范围内，获取超越基准的业绩表现。 | |
| 业绩比较基准 | 创业板指数收益率×95%+银行活期存款利率×5% | |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型指数基金，属于高风险高收益的基金品种，其收益和风险均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 | |
| 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 | 融通创业板指数A/B | 融通创业板指数C |
| 下属分级基金的交易代码 | 161613 | 004870 |
| 下属分级基金的前端交易代码 | 161613 | - |
| 下属分级基金的后端交易代码 | 161663 | - |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 583,023,533.66份 | 651,209.27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(2017年10月1日-2017年12月31日) | |
|---|---|---|
| | 融通创业板指数A/B | 融通创业板指数C |
| 1.本期已实现收益 | -6,469,074.30 | -5,875.67 |
| 2.本期利润 | -37,038,597.57 | -34,391.15 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0654 | -0.0734 |
| 4.期末基金资产净值 | 476,213,754.15 | 530,677.28 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.817 | 0.815 |

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

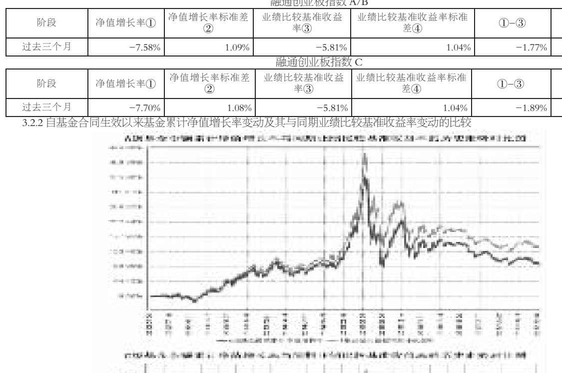
融通创业板指数A/B

| 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 | -7.58% | 1.09% | -5.81% | 1.04% | -1.77% | 0.05% |

融通创业板指数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 | -7.70% | 1.08% | -5.81% | 1.04% | -1.89% | 0.04% |

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



| 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 | 019563 | 17国债09 | 150,000 | 14,977,500.00 | 3.14 |
| 2 | 123006 | 东财转债 | 14,368 | 1,436,793.70 | 0.30 |
| 3 | 123003 | 蓝思转债 | 3,770 | 376,997.52 | 0.08 |
| 4 | 123004 | 铁汉转债 | 2,694 | 269,398.23 | 0.06 |
| 5 | 123005 | 万信转债 | 2,692 | 269,198.23 | 0.06 |

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