

# 融通跨界成长灵活配置混合型证券投资基金 2015 年第 4 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	融通跨界成长灵活配置混合
交易代码	001830
前端交易代码	001830
后端交易代码	001831
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 9 月 30 日
报告期末基金份额总额	215,319,922.68 份
投资目标	本基金重点投资于进行跨界发展的公司，在合理控制投资风险的基础上，力争把握该类型公司的投资机会，获取基金资产的长期稳健增值。
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（2015 年 10 月 1 日 — 2015 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	16,397,702.20
2. 本期利润	29,678,305.30
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1743
4. 期末基金资产净值	255,627,264.68
5. 期末基金份额净值	1.187

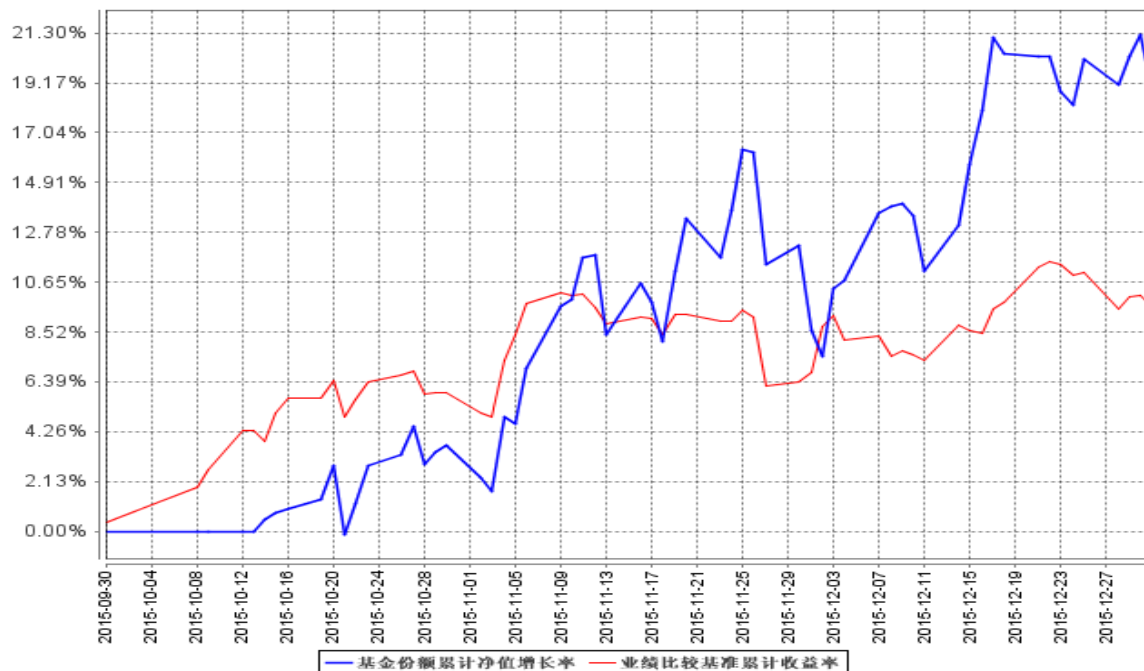
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	18.70%	1.62%	9.14%	0.83%	9.56%	0.79%

##### 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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同生效日为 2015 年 9 月 30 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，本基金尚在建仓期内。

## § 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		
商小虎	本基金的基金经理	2015 年 9 月 30 日	-	14	上海社会科学院经济学博士，澳门大学及上海社会科学院经济学硕士，复旦大学经济学本科，美国特许金融分析师（CFA），十四年证券及投资从业经历。历任日本东京三菱银行旗下和昇证券行业分析员、上海国际集团（就任时为上海国有资产经营有限公司）投资经理并被选派至香港子公司任职副总经理、中银国际证券资产管理部副总经理，现任融通基金投资总监。

### 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，随着清理场外配资告一段落，市场迎来了反弹的走势。A 股风格指数中，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%，中小创明显呈现强势反弹格局，市场情绪也逐步得到了修复。

融通跨界成长在建仓过程中，通过逐步建立收益安全垫的方式获得了净值的稳步上涨。本产品重点寻找企业跨界成长的投资机会，符合当前中国产业转型的大趋势，因此取得了较好的回报。随着我国经济增长阶段由投资驱动转向创新驱动，这意味着企业转移经营重心，开始着眼于根据用户的需求提供完整解决方案，而不仅仅局限于自身所属行业。未来的主流趋势必然是企业根据自身的竞争优势扬长避短、兼并重组、相互融合；同时，地区、行业、时间甚至人与人之间的界限也将变得越来越模糊。因此，我们看到大量的上市公司积极开展跨界整合，为本产品带来了巨大的投资机会。

展望 2016 年一季度，我们判断经济数据依旧疲软，传统行业盈利恢复仍需时日。另一方面，供给侧改革有望进一步深化，资本市场必将展现出更多的企业跨界成长的浪潮。经历 2015 年跌宕起伏的市场表现后，广大投资者对于权益投资的大时代有望进一步形成共识。资本市场日益发挥出对于国内朝阳产业和优质上市资源的支持功能，专业投资者也可以更好地通过资本市场分享中国崛起和产业升级的果实。

综上所述，融通跨界成长基金将会继续坚持跨界成长的组合构建思路，通过研究创造价值，力争为持有人获取风险调整后的稳定收益。

#### 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 18.70%，同期业绩比较基准收益率为 9.14%。

#### 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	218,599,180.96	84.94
	其中：股票	218,599,180.96	84.94
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	36,230,550.87	14.08
8	其他资产	2,530,126.50	0.98
9	合计	257,359,858.33	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	89,954,788.63	35.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	22,821,371.10	8.93
F	批发和零售业	33,760,041.04	13.21
G	交通运输、仓储和邮政业	7,009,205.00	2.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,011,559.51	8.22
J	金融业	-	-
K	房地产业	17,453,000.00	6.83
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	4,901,215.68	1.92
R	文化、体育和娱乐业	21,688,000.00	8.48
S	综合	-	-
	合计	218,599,180.96	85.51

## 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	002717	岭南园林	519,849	22,821,371.10	8.93
2	002343	禾欣股份	240,000	14,568,000.00	5.70
3	300299	富春通信	289,950	13,647,946.50	5.34
4	002127	新民科技	687,451	12,869,082.72	5.03

5	603883	老百姓	179,932	12,769,774.04	5.00
6	600622	嘉宝集团	700,000	11,893,000.00	4.65
7	002640	跨境通	349,990	11,654,667.00	4.56
8	002217	合力泰	610,000	10,339,500.00	4.04
9	600217	*ST 秦岭	980,000	10,211,600.00	3.99
10	002157	正邦科技	399,979	8,039,577.90	3.15

#### 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

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 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

本基金本报告期末未投资国债期货。

##### 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

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 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，没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 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	69,250.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,761.97
5	应收申购款	2,452,113.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,530,126.50

### 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	300,841,431.29
报告期期间基金总申购份额	165,321,680.63
减：报告期期间基金总赎回份额	250,843,189.24
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	215,319,922.68

## § 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）《融通跨界成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》



- (二) 《融通跨界成长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (三) 《融通跨界成长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- (四) 中国证监会批准融通跨界成长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

## 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](http://www.rtfund.com) 查询。

融通基金管理有限公司  
2016 年 1 月 22 日