

融通通盈保本混合型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告

2016 年 6 月 30 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 7 月 19 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 7 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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 4 月 1 日起至 6 月 30 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 | 1,026,026,738.54 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，Time Invariant Portfolio Protection），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（2016 年 4 月 1 日 — 2016 年 6 月 30 日） |
| 1. 本期已实现收益 | 4,007,673.08 |

| | |
|-----------------|------------------|
| 2. 本期利润 | 5,207,270.32 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0050 |
| 4. 期末基金资产净值 | 1,031,456,713.13 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.005 |

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。

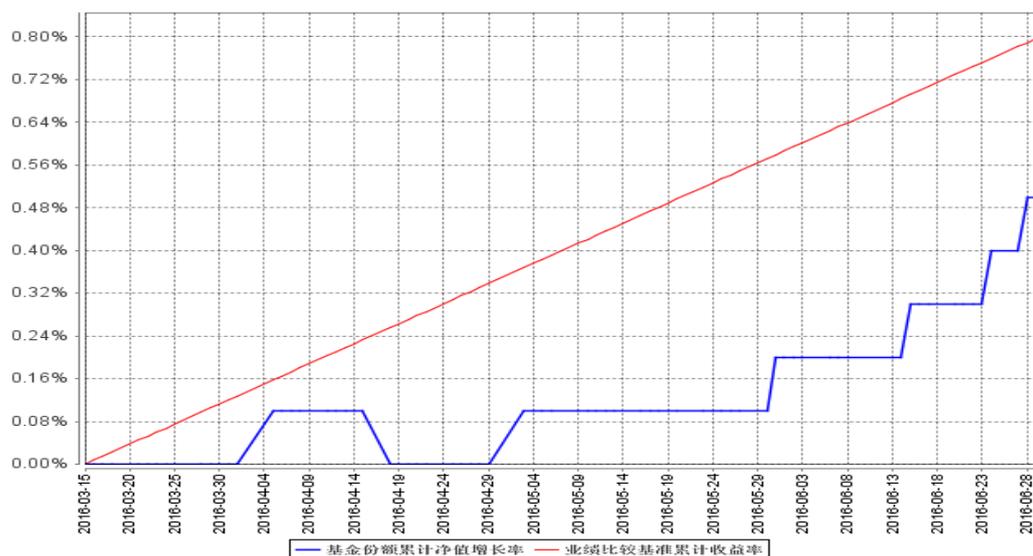
3.2 基金净值表现

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 | 0.50% | 0.03% | 0.68% | 0.01% | -0.18% | 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

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 2016 年 3 月 15 日。

2、本基金的建仓期为自合同生效日起 6 个月。截止本报告期末, 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 | 证券从 | 说明 |
|----|----|---------|-----|----|
|----|----|---------|-----|----|

| | | 经理期限 | | 业年限 | |
|-----|---|-----------------|------|-----|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 张一格 | 融通易支付货币市场证券投资基金、融通通盈保本混合型证券投资基金、融通增裕债券型证券投资基金、融通增祥债券型证券投资基金的基金经理。 | 2016 年 5 月 13 日 | - | 9 | 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）。9 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部总经理。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型发起式证券投资基金、国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰信用债券型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金基金经理。2015 年 6 月加入融通基金管理有限公司，2015 年 11 月 17 日起至今任“融通易支付货币市场证券投资基金”基金经理，2016 年 3 月 15 日起至今任“融通通盈保本混合型证券投资基金”基金经理，2016 年 4 月 28 日起至今任“融通增裕债券型证券投资基金”基金经理，2016 年 5 月 13 日起至今任“融通增祥债券型证券投资基金”基金经理。 |

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

2016 年二季度，受信用事件频发的影响，市场对信用债变得恐慌，带动信用债收益率大幅上行。5 月份之后随着市场情绪的缓解及经济表现的低迷，高评级债券的收益率重新开始缓慢下行。

股票市场在二季度呈现 U 形走势，整体微跌，但结构性机会不断，新能源汽车、OLED、稀土等成为存量资金追捧的热点。

本基金在债券方面维持了低久期的运作，稳步积累浮盈。在权益方面，积极参与新股发行，同时配置上重视银行、白酒、医药、家电等板块。

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 0.50%，同期业绩比较基准收益率为 0.68%。

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 | 21,157,521.86 | 1.73 |
| | 其中：股票 | 21,157,521.86 | 1.73 |
| 2 | 固定收益投资 | 789,115,466.11 | 64.68 |
| | 其中：债券 | 743,517,466.11 | 60.94 |
| | 资产支持证券 | 45,598,000.00 | 3.74 |
| 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 | 372,744,284.73 | 30.55 |
| 7 | 其他资产 | 37,016,713.42 | 3.03 |
| 8 | 合计 | 1,220,033,986.12 | 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 | 13,617,196.08 | 1.32 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 210,957.28 | 0.02 |
| F | 批发和零售业 | 1,685,000.00 | 0.16 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 629,200.00 | 0.06 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 70,492.40 | 0.01 |
| J | 金融业 | 4,516,800.00 | 0.44 |
| K | 房地产业 | 215,750.00 | 0.02 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 20,126.10 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 192,000.00 | 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 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 21,157,521.86 | 2.05 |

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 | 600104 | 上汽集团 | 120,000 | 2,434,800.00 | 0.24 |
| 2 | 000001 | 平安银行 | 264,000 | 2,296,800.00 | 0.22 |
| 3 | 601398 | 工商银行 | 500,000 | 2,220,000.00 | 0.22 |
| 4 | 600519 | 贵州茅台 | 7,500 | 2,189,400.00 | 0.21 |
| 5 | 600276 | 恒瑞医药 | 51,600 | 2,069,676.00 | 0.20 |
| 6 | 000858 | 五粮液 | 60,000 | 1,951,800.00 | 0.19 |
| 7 | 000963 | 华东医药 | 25,000 | 1,685,000.00 | 0.16 |
| 8 | 000538 | 云南白药 | 23,000 | 1,478,900.00 | 0.14 |
| 9 | 000333 | 美的集团 | 45,000 | 1,067,400.00 | 0.10 |
| 10 | 002007 | 华兰生物 | 24,000 | 753,600.00 | 0.07 |

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 | 6,340,250.00 | 0.61 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 231,052,000.00 | 22.40 |

| | | | |
|----|-----------|----------------|-------|
| | 其中：政策性金融债 | 180,227,000.00 | 17.47 |
| 4 | 企业债券 | 195,483,240.57 | 18.95 |
| 5 | 企业短期融资券 | 289,949,000.00 | 28.11 |
| 6 | 中期票据 | 20,414,000.00 | 1.98 |
| 7 | 可转债 | 278,975.54 | 0.03 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 743,517,466.11 | 72.08 |

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 | 50,825,000.00 | 4.93 |
| 2 | 011699977 | 16 中铁股 SCP001 | 500,000 | 49,965,000.00 | 4.84 |
| 3 | 160206 | 16 国开 06 | 500,000 | 49,940,000.00 | 4.84 |
| 4 | 011699982 | 16 鲁高速集 SCP005 | 400,000 | 40,020,000.00 | 3.88 |
| 5 | 011698018 | 16 云南白药 SCP001 | 400,000 | 39,996,000.00 | 3.88 |

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 | 1689123 | 16 德宝天元 1A1 | 200,000 | 19,974,000.00 | 1.94 |
| 2 | 1689124 | 16 德宝天元 1A2 | 200,000 | 19,938,000.00 | 1.93 |
| 3 | 1689116 | 16 中誉 1 优先 | 200,000 | 5,686,000.00 | 0.55 |

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，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 | 20,831.78 |
| 2 | 应收证券清算款 | 30,420,406.09 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 6,574,289.77 |
| 5 | 应收申购款 | 1,185.78 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 37,016,713.42 |

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 | 1,045,740,102.83 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 3,861.46 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 19,717,225.75 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 1,026,026,738.54 |

§ 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》
- (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、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 7 月 19 日