

融通中国风 1 号灵活配置混合型证券投资基金

2019 年第 3 季度报告

2019 年 9 月 30 日

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 10 月 25 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2019年10月18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2019年7月1日起至2019年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通中国风1号灵活配置混合
基金主代码	001852
前端交易代码	001852
后端交易代码	001853
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年2月3日
报告期末基金份额总额	991,125,261.89份
投资目标	本基金精选优质上市公司进行投资，分享相关行业、上市公司发展过程中的投资机会，在保证本金安全的前提下，力争实现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(2019年7月1日-2019年9月30日)
--------	---------------------------

1. 本期已实现收益	25,362,751.40
2. 本期利润	109,226,905.55
3. 加权平均基金份额本期利润	0.2044
4. 期末基金资产净值	1,609,607,017.37
5. 期末基金份额净值	1.624

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	17.34%	1.33%	0.16%	0.48%	17.18%	0.85%

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

融通中国风1号灵活配置混合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



§ 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		
彭炜	本基金的基金经理	2017年8月5日	-	7	彭炜先生，上海交通大学管理科学与工程硕士，7年证券投资从业经历，具有基金从业资格。2012年4月加入融通基金管理有限公司，历任建筑建材行业研究员、房地产行业研究员、钢铁煤炭行业研究员、周期行业研究组组长、融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现任融通中国风1号灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通通慧混合型证券投资基金基金经理、融通消费升级混合型证券投资基金基金经理、融通量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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

三季度在G20峰会后中美关系取得一定程度上的缓解，同时政治局会议再次提及进一步加大逆周期调控以稳定经济增长，市场整体风险偏好得到明显改善，在结构上呈现以成长股为代表的

创业板指数上涨7.68%，而上证指数则小幅下跌2.47%。

回顾三季度，在6月底日本G20峰会期间中美关系释放出改善的信号，因此本基金组合积极在以5G硬件、华为产业链等具有业绩景气趋势改善的相关科技板块上提高了配置比例，从而在7-8月的中报季行情中取得了较为不错的超额收益。同时7月份的政治局会议重新定调对经济稳增长的重要性，结构上依然保持一定比例的受益逆周期调节的投资品板块；另外考虑政策层面的压力小幅减配生猪养殖板块；而在大消费板块上依然维持以医药消费等为代表的个股作为组合的稳健成长性品种。

本基金组合核心资产依然维持在以大科技+大消费的方向上积极布局具有产业趋势和景气改善的细分行业，板块配置相对均衡，细分方向为5G产业链硬件、以华为产业链为代表的核心硬件国产化、医药消费、地产竣工产业链、生猪养殖、金融供给侧结构性改革等。

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1.624元；本报告期基金份额净值增长率为17.34%，业绩比较基准收益率为0.16%。

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	1,398,287,168.87	85.87
	其中：股票	1,398,287,168.87	85.87
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	186,389,034.90	11.45
8	其他资产	43,668,168.68	2.68
9	合计	1,628,344,372.45	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	96,811,365.34	6.01
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,025,092,488.50	63.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	138,196,977.29	8.59
J	金融业	72,401,386.20	4.50
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	65,784,951.54	4.09
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	1,398,287,168.87	86.87

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	002475	立讯精密	4,803,176	128,532,989.76	7.99
2	000661	长春高新	325,317	128,292,012.12	7.97
3	002798	帝欧家居	4,233,487	84,204,056.43	5.23
4	002241	歌尔股份	4,697,154	82,575,967.32	5.13
5	300725	药石科技	937,490	74,999,200.00	4.66
6	600030	中信证券	3,219,000	72,363,120.00	4.50
7	603160	汇顶科技	336,711	68,487,017.40	4.25
8	300498	温氏股份	1,801,288	66,971,887.84	4.16
9	002463	沪电股份	2,720,379	66,649,285.50	4.14
10	601888	中国国旅	706,909	65,784,951.54	4.09

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货投资。本基金将根据对现货和期货市场的分析,发挥股指期货杠杆效应和流动性好的特点,采用股指期货在短期内取代部分现货,获取市场敞口,投资策略包括多头套期保值和空头套期保值。

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

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

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	337,598.93
2	应收证券清算款	1,942,970.35
3	应收股利	-
4	应收利息	34,131.55
5	应收申购款	41,353,467.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	43,668,168.68

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	487,449,143.05
报告期期间基金总申购份额	1,152,260,211.36
减：报告期期间基金总赎回份额	648,584,092.52
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	991,125,261.89

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	7,929,605.48
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	7,929,605.48
报告期期末管理人持有的本基金份额	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	网上直销赎回	2019年7月24日	-7,929,605.48	-11,587,829.85	0.25
合计			-7,929,605.48	-11,587,829.85	

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- (一) 《融通中国风1号灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (二) 《融通中国风1号灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (三) 《融通中国风1号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中国风1号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

2019年10月25日