

融通沪港深智慧生活灵活配置混合型证券投资基金
2020 年第 3 季度报告

2020 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 10 月 27 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 2020 年 10 月 26 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 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	融通沪港深智慧生活灵活配置混合
基金主代码	003279
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 8 日
报告期末基金份额总额	448,332,439.12 份
投资目标	本基金重点投资于属于智慧生活主题的公司，在合理控制投资风险的基础上，力争把握该主题公司的投资机会，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包括大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略、金融衍生工具投资策略等部分。
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×40%+中证香港 100 指数收益率×10%。
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。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。
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

§ 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（2020 年 7 月 1 日-2020 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	23,574,682.53
2. 本期利润	24,308,097.04

3. 加权平均基金份额本期利润	0.0616
4. 期末基金资产净值	551,080,072.63
5. 期末基金份额净值	1.2292

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	8.03%	0.68%	4.41%	0.87%	3.62%	-0.19%
过去六个月	13.63%	0.55%	11.44%	0.74%	2.19%	-0.19%
过去一年	16.01%	0.59%	10.24%	0.79%	5.77%	-0.20%
过去三年	21.58%	0.90%	13.16%	0.75%	8.42%	0.15%
自基金合同 生效起至今	22.92%	0.82%	21.49%	0.68%	1.43%	0.14%

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

融通沪港深智慧生活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		
余志勇	本基金的基金经理、组合投资部总监	2019-6-11	-	20	余志勇先生，武汉大学金融学硕士，20 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。1992 年 7 月至 1997 年 9 月就职于湖北省农业厅任研究员，2000 年 7 月至 2004 年 7 月就职于闽发证券公司任研究员，2004 年 7 月至 2007 年 4 月就职于招商证券股份有限公司任研究员。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、行业研究组组长、研究部总监、融通领先成长混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理、融通通泽灵活配置混合基金基金经理、融通增裕债券型证券投资基金基金经理、融通增丰债券型证券投资基金基金经理、融通通景灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通通尚灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通新优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通通润债券型证券投资基金基金经理、融通通颐定期开放债券型证券投资基金基金经理、融通新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通通泰保本混合型证券投资基金基金经理，现任组合投资部总监、融通通鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通四季添利债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理、融通通慧混合型证券投资基金基金经理、融通沪港深智慧生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通增强收益债券型证券投资基金基金经理、融通蓝筹成长证券投资基金基金经理、融通新消费灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
何博	本基金的基金经理	2018-1-5	-	8	何博女士，上海财经大学金融学硕士，8 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2012 年 7 月加入融通基金管理有限公司，历任 QDII 研究员、国际业务部专户投资经理，现任融通沪港深智慧生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通核心价值混合型证券投资基金 (QDII) 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、基金从业年限以从事证券业务相关的工作时间为计算标准。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，全球风险资产涨幅较前期普遍收敛，市场波动有所抬升，中美在经贸、科技、金融、地缘等诸多领域出现摩擦，持续影响市场风险偏好，部分投资者担忧国内货币政策回归常态下的利率回升及极端估值分化下高估值板块调整风险，短期内外资流出。报告期内，中资股主要指数表现方面，A股再度大幅跑赢港股，上证指数、创业板指数分别上涨 7.82% 和 5.60%，恒生指数、恒生国企指数分别下跌 3.96% 和 3.70%。A股行业表现方面，按申万一级行业分类，休闲服务、国防军工、电气设备、汽车、食品饮料板块涨幅遥遥领先，通信、商业贸易、计算机、农林牧渔、银行板块表现显著落后。A股风格表现方面，大盘股显著跑赢中小盘股。报告期内人民币汇率走强，美元中间价下跌 3.82%。

海外方面，欧美等地区 9 月制造业 PMI 数据有所波动，但整体仍然处于高位。尽管疫情在局部区域有所反弹，但防疫经验和能力提升，死亡率呈显著下降，疫情对经济活动及市场情绪的边际影响弱化，目前市场对新冠疫苗年内临床试验成功抱有很大憧憬。未来一段时期市场关注焦点集中在美国大选和中美关系。

国内方面，经济复苏持续深化，制造业 PMI 已连续 7 个月保持在荣枯线以上，其中新出口订单指数年内首次站上 50，新订单指数和新出口订单指数双双处于荣枯线以上，反映需求的逐步恢复。预计三季度企业盈利有望进一步修复。十一黄金周期间餐饮、零售、电影、旅游等呈现良好恢复。

报告期内，基金配置延续向 A 股倾斜，保持了整体低仓位运作。为增强基金收益，报告期内参与新股申购。截至报告期末，基金在工业、信息技术、日常消费板块配置比例较高。

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 1.2292 元；本报告期基金份额净值增长率为 8.03%，业绩比较基准收益率为 4.41%。

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	136,386,944.09	24.34
	其中：股票	136,386,944.09	24.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	40,545,068.90	7.24
	其中：债券	40,545,068.90	7.24
	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	18,000,000.00	3.21
	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	364,259,042.34	65.02
8	其他资产	1,067,130.23	0.19
9	合计	560,258,185.56	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	99,926,215.78	18.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	13,029.12	0.00
F	批发和零售业	2,727,683.79	0.49
G	交通运输、仓储和邮政业	6,044,568.96	1.10
H	住宿和餐饮业	786,861.00	0.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,223,929.68	1.86
J	金融业	4,605,986.00	0.84

K	房地产业	1,366,477.00	0.25
L	租赁和商务服务业	6,437,896.00	1.17
M	科学研究和技术服务业	14,813.40	0.00
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	1,494,454.00	0.27
Q	卫生和社会工作	2,228,070.00	0.40
R	文化、体育和娱乐业	516,959.36	0.09
S	综合	-	-
	合计	136,386,944.09	24.75

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	600031	三一重工	313,100	7,793,059.00	1.41
2	600519	贵州茅台	3,900	6,507,150.00	1.18
3	601888	中国中免	24,700	5,506,618.00	1.00
4	002475	立讯精密	95,000	5,427,350.00	0.98
5	601816	京沪高铁	906,536	5,303,235.60	0.96
6	600276	恒瑞医药	52,780	4,740,699.60	0.86
7	601100	恒立液压	51,790	3,697,806.00	0.67
8	000661	长春高新	8,300	3,068,012.00	0.56
9	002241	歌尔股份	68,800	2,781,584.00	0.50
10	603939	益丰药房	27,300	2,710,890.00	0.49

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	20,056,000.00	3.64
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	533,068.90	0.10
8	同业存单	19,956,000.00	3.62
9	其他	-	-
10	合计	40,545,068.90	7.36

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	136057	15 华发 01	200,000	20,056,000.00	3.64
2	112021373	20 渤海银行 CD373	200,000	19,956,000.00	3.62
3	110059	浦发转债	4,430	453,233.30	0.08
4	113038	隆 20 转债	520	79,835.60	0.01

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

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。

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**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	66,420.53
2	应收证券清算款	194,918.20
3	应收股利	-
4	应收利息	805,791.50
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,067,130.23

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	453,233.30	0.08

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	203,901,229.66
报告期期间基金总申购份额	287,288,813.10
减：报告期期间基金总赎回份额	42,857,603.64
报告期期末基金份额总额	448,332,439.12

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

无。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额

		的时间区间					
机构	1	20200701-20200706	51,087,624.21	28,229,486.43	-	79,317,110.64	17.69
	2	20200707-20200713	-	58,405,506.88	-	58,405,506.88	13.03
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时,可能存在因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金单位份额净值剧烈波动的风险及流动性风险。							

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准融通沪港深智慧生活灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通沪港深智慧生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通沪港深智慧生活灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通沪港深智慧生活灵活配置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。

融通基金管理有限公司

2020 年 10 月 27 日