

中融竞争优势股票型证券投资基金 2017年第一季度报告

2017年03月31日

基金管理人:中融基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司 报告送出日期:2017年04月21日

重要提示 基金管理人及董事保证本报告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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月17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,保证基金资产不存在虚假记载、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先仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期中的财务资料未经审计。 本报告期自2017年1月1日起至2017年3月31日止。

2.1 基金基本情况

Table with 2 columns: Item (基金名称, 基金代码, etc.) and Value (中融竞争优势, 003145, etc.)

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: Item (本期已实现收益, 本期利润, etc.) and Value (-23,518,437.34, -12,798,716.90, etc.)

3.2 基金净值表现

Table with 2 columns: Item (过去三个月, 自基金合同生效以来, etc.) and Value (-6.14%, 1.16%, etc.)

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 序号, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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名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

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现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。

5.11.2 基金投资的前十名股票未超过基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 流通受限部分公允价值, 占基金资产净值比例(%)

5.11.6 影响投资者决策的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,各比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

5.6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: Item (报告期初基金份额总额, 报告期末基金份额总额, etc.) and Value (242,720,897.88, 225,591,518.60, etc.)

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

5.8 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

本基金本报告期间无单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

5.9 备查文件目录

- (1)中国证监会准予中融竞争优势股票型证券投资基金募集注册的文件
- (2)《中融竞争优势股票型证券投资基金基金合同》
- (3)《中融竞争优势股票型证券投资基金托管协议》
- (4)关于申请募集中融竞争优势股票型证券投资基金之法律意见书
- (5)基金管理人业务资格批件、营业执照
- (6)基金托管人业务资格批件、营业执照
- (7)中国证监会要求的其他文件
- (8)存放地点:基金管理人办公场所或托管人住所
- (9)查阅方式:投资者可在营业时间免费查阅,也可在支付工本费后,在合理时间取得上述文件的复印件

咨询电话:中融基金管理有限公司客户服务 400-160-6000(免长途话费), (010)85003210

网址: http://www.zrfunds.com.cn/

中融基金管理有限公司 二〇一七年四月二十一日

中融量化多因子混合型发起式证券投资基金 2017年第一季度报告

2017年03月31日

基金管理人:中融基金管理有限公司 基金托管人:中国银河证券股份有限公司 报告送出日期:2017年04月21日

重要提示 基金管理人及董事保证本报告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。

基金托管人中国银河证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月20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,保证基金资产不存在虚假记载、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先仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期中的财务资料未经审计。 本报告期自2017年1月1日起至2017年3月31日止。

2.1 基金基本情况

Table with 2 columns: Item (基金简称, 基金代码, etc.) and Value (中融量化多因子混合, 004065, etc.)

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: Item (本期已实现收益, 本期利润, etc.) and Value (707,307.91, -1,941,004.98, etc.)

3.2 基金净值表现

Table with 2 columns: Item (过去三个月, 自基金合同生效以来, etc.) and Value (-2.13%, 0.99%, etc.)

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:按照基金合同和招募说明书的约定,本基金自合同生效之日起6个月内为建仓期,截至本报告期末仍在建仓期内。

4.1 基金管理人报告

4.1.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 说明

注:(1)上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写

(2)证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

报告期内,本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项配套法规、《中融量化多因子混合型发起式证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,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,为基金份额持有人谋求最大利益,本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本公司制定了《公平交易管理办法》并严格执行,公司通过建立科学、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,在研究、决策、交易执行等各环节,通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合,保证公平交易原则的实现。

报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好,不同的投资组合受到了公平对待,未发生不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2017年一季度,A股维持窄幅震荡,呈现结构性行情。上证综指上涨3.83%,沪深300上涨4.41%,中证500上涨2.20%,中小板指上涨4.22%,创业板指下跌2.79%。申万一级行业涨跌互现,其中家用电器、食品饮料、国防军工行业涨幅居前,而传媒、农林牧渔、纺织服装等行业跌幅居前。整体而言,大市值个股跑赢中小盘成长股。期间,本基金通过多因子量化选股模型,精选具有超额收益的股票组合进行投资,在充分控制风险的前提下,力争长期稳定的获取超额业绩比较基准的投资回报。

一季度国内房地产限购政策继续加码,央行公开市场操作变相提高市场利率,国际原油价格再次加息,均对宏观经济造成了一定压力,但相关宏观经济数据仍体现了较强的复苏势头,外汇储备也止跌回升重新站上三万亿美元。展望二季度,房地产价格受到抑制,债市杠杆也已出现一定程度回落,防泡沫、降杠杆问题得到缓解,随着制造业投资和民间投资的稳步回升,中国经济增长动能将逐渐修复,A股市场的整体风险偏好也有望提升。

本基金将继续以多因子选股模型为基础,结合强大的优化系统,在坚持模型驱动的纪律性投资的基础上,辅以定性分析,遵循精细化的投资流程,严格控制组合的多维度的风险暴露,以期获得较为理想的投资收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中融量化多因子混合基金份额净值为0.9785元;本报告期基金份额净值增长率为-2.13%,同期业绩比较基准收益率为2.10%。

5.1 投资组合报告

5.1.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 序号, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

Table with 4 columns: 序号, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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名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

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现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。

5.11.2 基金投资的前十名股票未超过基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 流通受限部分公允价值, 占基金资产净值比例(%)

5.11.6 影响投资者决策的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,各比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

5.6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: Item (报告期初基金份额总额, 报告期末基金份额总额, etc.) and Value (89,696,268.79, 10,900,388.92, etc.)

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

5.8 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table with 5 columns: 项目, 持有份额总数, 持有份额占基金总份额比例(%)

5.9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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

Table with 5 columns: 序号, 持有基金份额比例达到或超过20%的区间, 期初份额, 申购份额, 赎回份额, 持有份额, 份额占比(%)

本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况,该类投资者大额赎回所持有的基金份额,将可能产生流动性风险,即基金资产不能迅速变现,或者未能以合理的价格变现基金资产以支付投资者赎回款,对资产净值产生不利影响。

当开放式基金发生大额赎回时,基金管理人认为基金组合资产变现能力有限或认为因应对赎回导致的资产变现对基金份额持有人产生较大影响时,为了切实保护基金份额持有人的合法权益,可能采取延期支付赎回款项等措施,同时为了公平对待所有投资者合法权益不受损害,管理人有权根据基金合同和招募说明书的约定,暂停或者拒绝申购、赎回申请,基金份额持有人存在无法及时赎回持有的全部基金份额的风险。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

(1)中国证监会准予中融量化多因子混合型发起式证券投资基金募集注册的文件

(2)《中融量化多因子混合型发起式证券投资基金基金合同》

(3)《中融量化多因子混合型发起式证券投资基金托管协议》

(4)关于申请募集注册中融量化多因子混合型发起式证券投资基金之法律意见书

(5)基金管理人业务资格批件、营业执照

(6)基金托管人业务资格批件、营业执照

(7)中国证监会要求的其他文件

10.2 查阅方式:基金管理人办公场所或托管人住所

投资者可在营业时间免费查阅,也可在支付工本费后,在合理时间取得上述文件的复印件

咨询电话:中融基金管理有限公司客户服务 400-160-6000(免长途话费), (010)85003210

网址: http://www.zrfunds.com.cn/

中融基金管理有限公司 二〇一七年四月二十一日