

融通创业板指数增强型证券投资基金

2012 第三季度 报告

2012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:2012年10月24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2012年10月22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。

本报告中所载资料未经审计。

本报告自2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通创业板指数
基金代码	161613
交易代码	161613(前端收费模式) 161663(后端收费模式)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年4月6日
报告期末基金份额总额	171,490,588.04份
投资目标	本基金在基金合同规定的范围内,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,结合增强收益的主动投资,力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏差度控制在0.5%以内,年化跟踪误差控制在7.75%以内。基金总体投资业绩超越创业板指数的表现。
投资策略	本基金为增强型指数基金,对指数投资组合,采用完全复制指数的投资策略,按照成份股在标的指数中的权重比例构建投资组合,并跟踪标的指数或投资及其权重的变化进行相应调整。本基金对主动投资部分采取积极投资策略,力争在跟踪误差控制范围内,获取超越基准的超额收益。
业绩比较基准	创业板指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,属于高风险收益的基金品种,其收益和风险均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
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(2012年7月1日—2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-950,172.60
2.本期利润	-8,255,697.45
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0409
4.期末基金资产净值	159,183,353.74
5.期末基金份额净值	0.928

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。

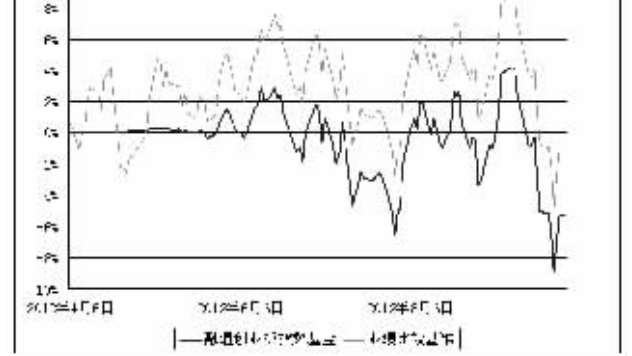
3.2 基金净值表现

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②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
----	--------	--------	------------	------------	-----	-----

过去三个月 -5.31% 1.52% -4.80% 1.56% -0.51% -0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来本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



注:1、本基金合同生效日为2012年4月6日。
2、本基金的建仓期为基金合同生效日起3个月。建仓期结束时,本基金各项资产配置比例符合《基金合同》的相关规定。

§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 任职日期 离任日期	证券从业 年限	说明
王健强	本基金基金经理、融通深证100指数证券投资基金、融通内需动力100指数证券投资基金、融通蓝筹成长证券投资基金基金经理	2012年4月6日	8	本科学历,具有证券从业资格。2004年5月至2004年6月在上海证券技术股份有限公司,2004年至今任职于融通基金管理有限公司,历任金融工程研究员、基金助理职务。
李勇	本基金的基金经理、融通深证成指证券投资基金基金经理	2012年4月6日	7	研究生学历,具有证券从业资格。2005年至今任职于融通基金管理有限公司,历任金融工程研究员、基金助理职务。

注:任职日期指基金经理人对外披露的任职日期填写;证券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》及其他有关法律法规、《融通创业板指数增强型证券投资基金基金合同》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。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。

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯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

本基金在基金合同规定的范围内,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,结合增强收益的主动投资,力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏差度控制在0.5%以内,年化跟踪误差控制在7.75%以内。基金总体投资业绩超越创业板指数的表现。

4.5 报告期内基金的投资表现

报告期内本基金净值增长率为-5.31%,同期业绩比较基准增长率为4.80%。从各行业类指数的表现来看:交通运输(申万)、纺织服装(申万)和机械装备(申万)跌幅超过10%。

5.1 报告期末基金资产组合情况

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:2012年10月24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2012年10月22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。

本报告中所载资料未经审计。

本报告自2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通领先成长股票(LOF)
基金代码	161610
交易代码	161610(前端收费模式) 161660(后端收费模式)
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2007年4月30日
报告期末基金份额总额	3,734,252,917.73份
投资目标	本基金主要投资于业绩持续高速增长的上市公司,通过积极持续的分散化投资策略,在严格控制风险的前提下实现基金资产的持续增值,为基金持有人获取长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金认为股价上升的主要驱动力来自于企业盈利的不断增长。在中国经济长期高速增长的大背景下,许多企业在一定期限内展现出较强的成长性,但只有符合产业发展趋势,同时在技术创新、经营模式、品牌、渠道、成本等方面具有领先地位的企业,才能保持业绩持续快速增长,而符合企业正是本基金重点投资的目标和获得长期超额收益的基础。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中信标普全债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金是较高预期收益较高预期风险的产品,其预期收益与风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
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

§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(2012年7月1日—2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-209,762,518.87
2.本期利润	-135,735,419.64
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0361
4.期末基金资产净值	2,505,413,490.19
5.期末基金份额净值	0.671

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。

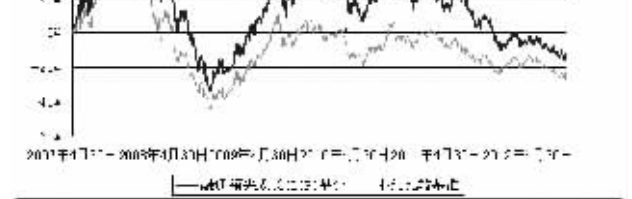
3.2 基金净值表现

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②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
----	--------	--------	------------	------------	-----	-----

过去三个月 -5.09% 0.93% -5.43% 0.95% 0.34% -0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来本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



序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	150,903,395.72	94.09
2	其中:股票	150,903,395.72	94.09
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	8,725,640.07	5.44
10	其他资产	749,726.46	0.47
11	合计	160,378,763.25	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	1,102,116.53	0.69
B	采掘业	2,000,198.50	1.26
C	制造业	83,419,553.83	52.40
C0	食品、饮料	3,490,443.45	2.19
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	2,114,679.64	1.33
C4	石油、化学、塑胶、塑料	7,992,912.94	5.02
C5	电子	16,026,793.44	10.07
C6	金属、非金属	4,242,335.12	2.67
C7	机械、设备、仪表	33,412,181.42	20.99
C8	医药、生物制品	16,140,207.82	10.14
C9	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,768,198.50	1.11
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	22,076,936.58	13.87
H	批发和零售业	3,924,444.52	2.47
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	19,219,917.06	12.07
L	传播与文化产业	17,392,030.21	10.93
M	综合类	-	-
合计		150,903,395.72	94.80

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

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	300070	碧水源	292,104	10,144,771.92	6.37
2	300027	华谊兄弟	360,333	5,570,748.18	3.50
3	300058	蓝色光标	237,625	5,061,412.50	3.18
4	300024	机器人	207,161	4,868,283.50	3.06
5	300146	海信视像	65,845	3,490,443.45	2.19
6	300039	上海凯宝	138,764	3,262,341.64	2.05
7	300104	乐视网	163,738	3,189,616.24	2.01
8	300026	红日药业	82,475	2,729,922.50	1.71
9	300005	探路者	154,352	2,716,595.20	1.71
10	300079	数码视讯	179,896	2,648,069.12	1.66

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.8.2 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同约定的备选股票库。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	706,867.16
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,630.64
4	应收股利	41,228.66
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	749,726.46

5.8.4 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。

5.8.5 报告期末股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.1 报告期末股票投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末股票投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.8.5.2 报告期末股票投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

§6 开放式基金份额变动

基金管理人、基金托管人处。

7.3 查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件,或登陆本基金管理人网站www.ritfund.com查询。

融通基金管理有限公司
二〇一二年十月二十四日

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准融通创业板指数增强型证券投资基金设立的文件

(二)《融通创业板指数增强型证券投资基金基金合同》

(三)《融通创业板指数增强型证券投资基金托管协议》

(四)《融通创业板指数增强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准和营业执照

(六)报告期内在指定报刊上披露的各项公告文件

7.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

7.3 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查询。

融通基金管理有限公司
二〇一二年十月二十四日

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:2012年10月24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2012年10月22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。

本报告中所载资料未经审计。

本报告自2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通领先成长股票(LOF)
基金代码	161610
交易代码	161610(前端收费模式) 161660(后端收费模式)
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2007年4月30日
报告期末基金份额总额	3,734,252,917.73份
投资目标	本基金主要投资于业绩持续高速增长的上市公司,通过积极持续的分散化投资策略,在严格控制风险的前提下实现基金资产的持续增值,为基金持有人获取长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金认为股价上升的主要驱动力来自于企业盈利的不断增长。在中国经济长期高速增长的大背景下,许多企业在一定期限内展现出较强的成长性,但只有符合产业发展趋势,同时在技术创新、经营模式、品牌、渠道、成本等方面具有领先地位的企业,才能保持业绩持续快速增长,而符合企业正是本基金重点投资的目标和获得长期超额收益的基础。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中信标普全债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金是较高预期收益较高预期风险的产品,其预期收益与风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
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

§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(2012年7月1日—2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-209,762,518.87
2.本期利润	-135,735,419.64
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0361
4.期末基金资产净值	2,505,413,490.19
5.期末基金份额净值	0.671

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②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
----	--------	--------	------------	------------	-----	-----

过去三个月 -5.09% 0.93% -5.43% 0.95% 0.34% -0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来本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

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	2,301,493,088.44	88.80
2	其中:股票	2,301,493,088.44	88.80
3	固定收益投资	100,070,000.00	3.86
4	其中:债券	100,070,000.00	3.86
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	186,574,724.49	7.20
10	其他资产	3,660,662.90	0.14
11	合计	2,591,798,495.83	100.00

§5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,301,493,088.44	88.80
2	其中:股票	2,301,493,088.44	88.80
3	固定收益投资	100,070,000.00	3.86
4	其中:债券	100,070,000.00	3.86
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	186,574,724.49	7.20
10	其他资产	3,660,662.90	0.14
11	合计	2,591,798,495.83	100.00

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号</
