

融通创业板指数增强型证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012年12月31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:2013年1月22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2013年1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预示其未来表现。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。

§2 基金产品概况

Table with columns: 基金简称, 基金代码, 交易代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人.

§3 主要财务指标和基金净值表现

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2012年10月1日-2012年12月31日), 单位:人民币元.

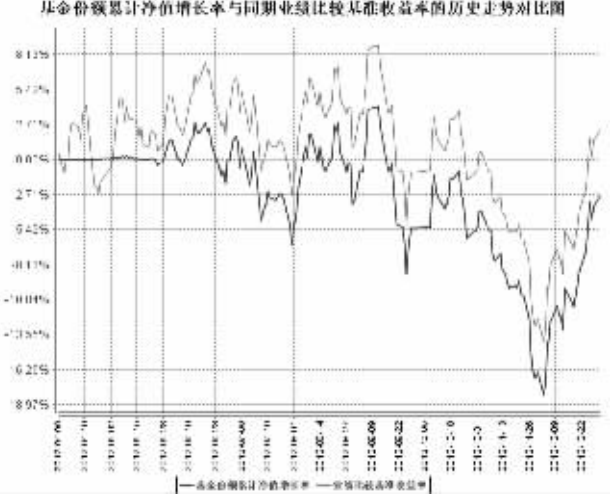
3.1 主要财务指标

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

Table with columns: 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③, 业绩比较基准收益标准差④, ①-③, ②-④.

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



注:1、本基金合同生效日为2012年4月6日。
2、本基金的建仓期为自基金合同生效日起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 基金经理

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明.

注:任职日期指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的工作时间为计算标准。

4.2 管理人报告期内本基金遵守运作规范情况的说明

本报告期内,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、《融通创业板增强型指数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,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为,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 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
本基金在基金合同约定的范围内,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离度控制在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
本报告期基金份额净值增长率为2.69%,同期业绩比较基准收益率为3.37%,从各行业类指数的表现来看:

房地产行业:金融服务 申万Y涨幅,涨幅达20%左右。

§5 投资组合报告

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

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%).

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%).

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五名股票投资明细

Table with columns: 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(%).

5.4 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

本基金本报告期末无股权投资部分股票。

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五名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末持有资产支持证券。

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 其他资产

注: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。
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。
3、其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元).

§6 开放式基金份额变动

Table with columns: 本报告期初基金份额总额, 本报告期基金总申购份额, 本报告期基金总赎回份额, 本报告期基金净申购份额, 本报告期末基金份额总额.

§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增强型指数证券投资基金设立的文件
(二)《融通创业板增强型指数证券投资基金基金合同》
(三)《融通创业板增强型指数证券投资基金托管协议》
(四)《融通创业板增强型指数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证件和营业执照
(六)报告期内在指定报刊上披露的各项公告
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
二〇一三年一月二十二日

融通医疗保健行业股票型证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012年12月31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:2013年1月22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2013年1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预示其未来表现。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。

§2 基金产品概况

Table with columns: 基金简称, 基金代码, 交易代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人.

§3 主要财务指标和基金净值表现

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2012年10月1日-2012年12月31日), 单位:人民币元.

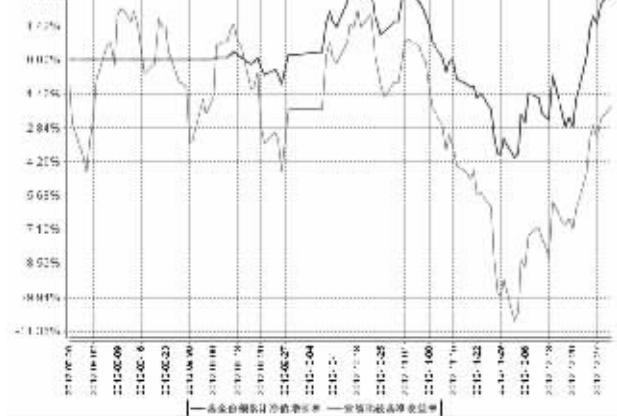
3.1 主要财务指标

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

Table with columns: 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③, 业绩比较基准收益标准差④, ①-③, ②-④.

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



注:1、本基金合同生效日为2012年7月26日。
2、本基金的建仓期为自基金合同生效日起6个月。截至报告期末,本基金尚在建仓期内。

§4 基金经理

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明.

注:任职日期指根据基金管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

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《融通创业板增强型指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规、《融通创业板增强型指数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,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为,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 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、《融通创业板增强型指数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,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为,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。
4.5 报告期内基金的投资表现
本报告期基金份额净值增长率为1.48%,同期业绩比较基准收益率为-0.13%。

融通四季添利债券型证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012年12月31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:2013年1月22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2013年1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预示其未来表现。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。

§2 基金产品概况

Table with columns: 基金简称, 基金代码, 交易代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人.

§3 主要财务指标和基金净值表现

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2012年10月1日-2012年12月31日), 单位:人民币元.

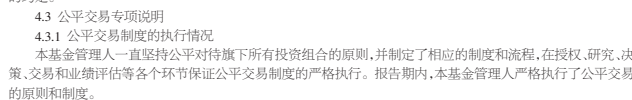
3.1 主要财务指标

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

Table with columns: 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③, 业绩比较基准收益标准差④, ①-③, ②-④.

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



注:任职日期指根据基金管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

本报告期内,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、《融通四季添利债券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,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为,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 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。

2012年四季度,融通医疗保健行业基金严格遵循基金契约要求,坚持“核心竞争力+高增长”的配置思路,积极操作,以获取超额收益为核心目标。2012年医药行业整体好转,上市公司业绩和市场表现出现了明显分化,我们坚持配置中药、医疗器械、化学药及生物制药行业的优质公司,注重企业盈利增长的稳定性,并且对一些趋势反弹品种进行波段操作。第四季度医药行业基金对于一些二、三品种的波段操作是业绩上贡献的主要原因。
展望2013年,我们对于医药板块整体平稳增长,基本能和大盘保持同步。医药行业政策层面将迎来基本药物目录扩大的公布,相关上市公司将受益,各地的非公立医院也将陆续拉开序幕,招标政策和价格不会发生大的变化,确保行业未来几年能有稳定增长,同时伴随12年报和13年一季度行情,但行业整体估值偏高位和创业板中股的解禁压力是主要不利因素,同时我们对于行业整体13年呈结构性上垒趋势。我们主要看好具有核心竞争力、业绩增长确定、能走出年底估值过高的成长股。
4.5 基金的业绩表现
本报告期基金份额净值增长率为2.69%,同期业绩比较基准收益率为0.12%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 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 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%).

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 columns: 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(%).

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五名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末持有资产支持证券。

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 其他资产

注: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。
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。
3、其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元).

§6 开放式基金份额变动

Table with columns: 本报告期初基金份额总额, 本报告期基金总申购份额, 本报告期基金总赎回份额, 本报告期基金净申购份额, 本报告期末基金份额总额.

§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医疗保健行业股票型证券投资基金设立的文件
(二)《融通医疗保健行业股票型证券投资基金基金合同》
(三)《融通医疗保健行业股票型证券投资基金托管协议》
(四)《融通医疗保健行业股票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证件和营业执照
(六)报告期内在指定报刊上披露的各项公告
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
二〇一三年一月二十二日

融通四季添利债券型证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012年12月31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:2013年1月22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2013年1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预示其未来表现。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。

§2 基金产品概况

Table with columns: 基金简称, 基金代码, 交易代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人.

§3 主要财务指标和基金净值表现

Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2012年10月1日-2012年12月31日), 单位:人民币元.

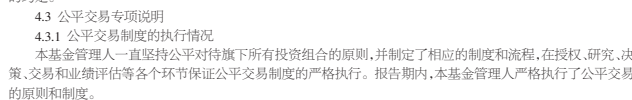
3.1 主要财务指标

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

Table with columns: 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③, 业绩比较基准收益标准差④, ①-③, ②-④.

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



注:任职日期指根据基金管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

本报告期内,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、《融通四季添利债券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,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为,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 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。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 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 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%).

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 columns: 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(%).

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五名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末持有资产支持证券。

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 其他资产

注: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。
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。
3、其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元).

§6 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with columns: 报告期末持有本基金基金份额, 报告期末买入总份额, 报告期末卖出总份额, 报告期末持有本基金基金份额占本基金总份额比例(%).

§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四季添利债券型证券投资基金设立的文件
(二)《融通四季添利债券型证券投资基金基金合同》
(三)《融通四季添利债券型证券投资基金托管协议》
(四)《融通四季添利债券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证件和营业执照
(六)报告期内在指定报刊上披露的各项公告
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http://www.rtfund.com查询。
融通基金管理有限公司
二〇一三年一月二十二日