

# 融通创业板指数增强型证券投资基金 2016 年第 4 季度报 告

2016 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：2017 年 1 月 20 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 2017 年 1 月 16 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 2016 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	融通创业板指数
交易代码	161613
前端交易代码	161613
后端交易代码	161663
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	480,862,145.74 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。
投资策略	本基金为增强型指数基金，对指数投资部分，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基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股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配置策略，力争在跟踪误差控制范围内，获取超越基准的业绩表现。
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，属于高风险高收益的基金品种，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（2016年10月1日—2016年12月31日）
1. 本期已实现收益	-8,569,156.67
2. 本期利润	-39,693,186.04
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0908
4. 期末基金资产净值	465,599,367.45
5. 期末基金份额净值	0.968

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。

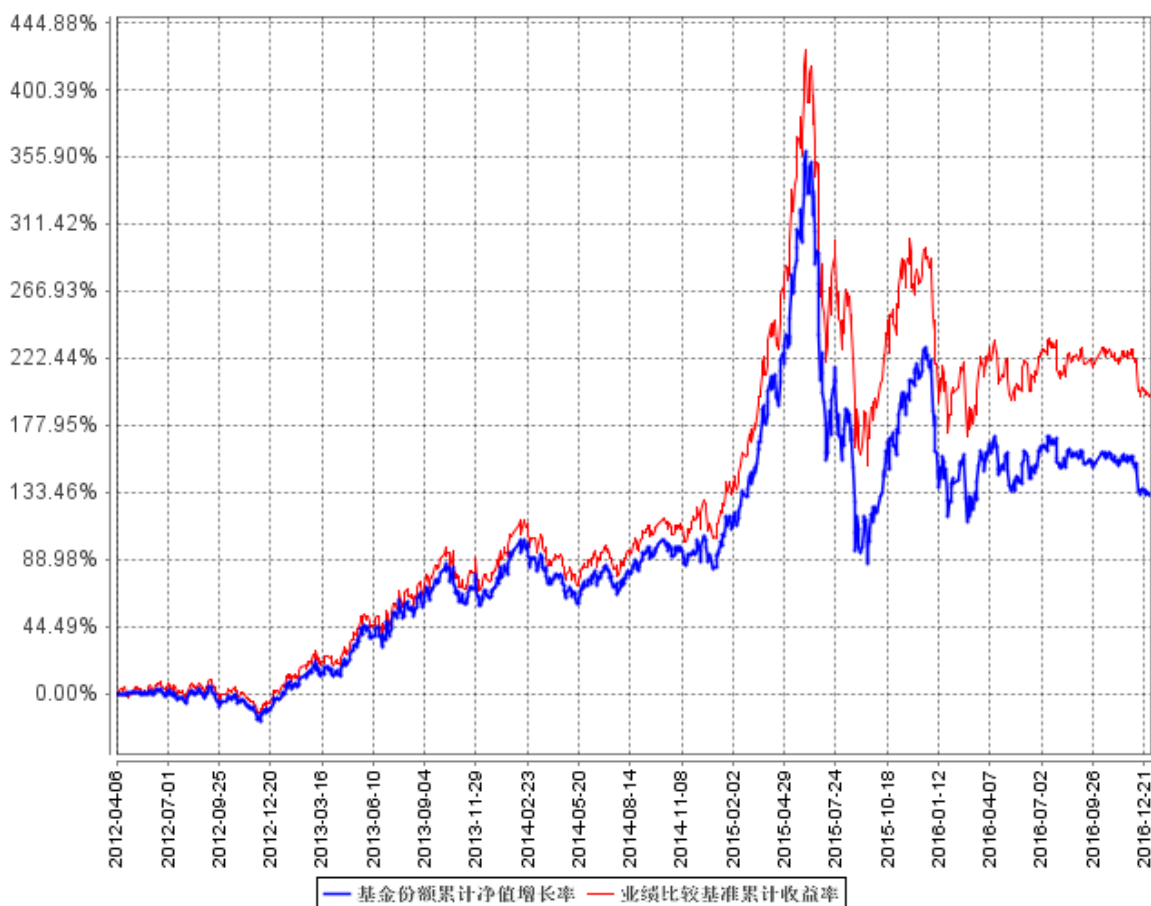
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	-8.25%	1.03%	-6.82%	1.02%	-1.43%	0.01%

### 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

基金份额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		
李勇	融通深证成份指数证券投资基金、融通创业板指数增强型证券投资基金、融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)的基金经理	2012年4月6日	-	11	李勇先生，厦门大学经济学硕士、安徽大学数学学士，11年证券投资从业经历，具有基金从业资格。2005年1月入职融通基金管理有限公司，历任金融工程研究员、基金经理助理职务。2010年11月15日起至今任“融通深证成份指数证券投资基金”基金经理，2012年4月6日起至今任“融通创业板指数增强型证券投资基金”基金经理，2015年1月9日起至今任“融通巨潮100指数证券投资基

					金 (LOF) ” 基金经理。
蔡志伟	融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理, 融通深证成份指数证券投资基金、融通创业板指数增强型证券投资基金的基金经理。	2016 年 11 月 19 日	-	5	蔡志伟先生, 华南师范大学计算机硕士、广州大学计算机学士, 金融风险管理师 (FRM), 5 年证券投资从业经历, 具有基金从业资格。曾就职于汇丰软件开发广东有限公司任高级软件工程师 (SSE)。2011 年 6 月加入融通基金管理有限公司, 历任风险管理专员、金融工程研究员, 2015 年 2 月 11 日起至今任“融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) ” 基金经理, 2016 年 11 月 19 日起至今任“融通深证成份指数证券投资基金”、“融通创业板指数增强型证券投资基金”基金经理。

注: 1. 任职日期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。

2. 自 2017 年 1 月 7 日起, 李勇先生不再担任本基金的基金经理, 由蔡志伟先生继续担任本基金的基金经理, 具体内容请参阅 2017 年 1 月 7 日在《上海证券报》、《中国证券报》及《证券时报》上刊登的公告。

## 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 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

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。

当前国内经济延续平稳态势，通胀或逐步温和回升，在经济企稳背景下资金将“脱虚向实”，同时监管层加大了去杠杆和严监管的力度，金融市场资金供给将受到挤压。在此背景下，我们看到政策在稳增长和改革转型方面正有序的不断推进，供给侧改革、PPP 项目持续推进；同时，创新仍是拉动经济增长的重要推动力之一，新兴产业仍是未来中国经济的主要发展方向和新的增长点。随着去杠杆和监管趋严，市场资金面和情绪面都将受到抑制，尤其是题材炒作等投机行为将受到严厉监管，投资将更加回归基本面。市场仍将存在结构性行情：随着供给侧改革以及稳增长政策推进，传统周期板块如基建和 PPP 相关等产业将受益；其次，中长期的潜在的通胀风险也将提升传统消费板块和资源品的投资价值；此外，创新和新兴成长的步伐没有停止，随着政策支持、商业模式创新以及业绩推动的进度，新能源、云计算、虚拟现实、人工智能、以及军工电子等都存在阶段性的结构性机会。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为-8.25%，同期业绩比较基准收益率为-6.82%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无

### § 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	437,643,217.59	93.34
	其中：股票	437,643,217.59	93.34
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	28,025,862.33	5.98
8	其他资产	3,205,487.23	0.68
9	合计	468,874,567.15	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末指数投资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	5,314,204.92	1.14
B	采矿业	-	-
C	制造业	206,748,925.44	44.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,070,985.92	1.09
F	批发和零售业	2,365,440.00	0.51
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	154,500,285.42	33.18
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	8,002,796.34	1.72
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	11,856,432.24	2.55
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	12,537,759.02	2.69
R	文化、体育和娱乐业	29,392,701.39	6.31
S	综合	-	-
	合计	435,789,530.69	93.60

### 5.2.2 报告期末积极投资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	采掘业	-	-
C	制造业	511,917.54	0.11
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	1,341,769.36	0.29

J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	1,853,686.90	0.40

### 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

#### 5.3.1 报告期末指数投资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	300059	东方财富	940,017	15,914,487.81	3.42
2	300070	碧水源	676,737	11,856,432.24	2.55
3	300072	三聚环保	254,278	11,770,528.62	2.53
4	300104	乐视网	327,067	11,708,998.60	2.51
5	300017	网宿科技	217,672	11,669,395.92	2.51
6	300024	机器人	492,979	10,539,891.02	2.26
7	300124	汇川技术	448,430	9,116,581.90	1.96
8	300136	信维通信	300,380	8,560,830.00	1.84
9	300027	华谊兄弟	717,285	7,890,135.00	1.69
10	300408	三环集团	474,871	7,540,951.48	1.62

#### 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

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	300300	汉鼎宇佑	51,752	1,084,721.92	0.23
2	300295	三六五网	8,550	247,009.50	0.05
3	002831	裕同科技	2,219	153,554.80	0.03
4	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.02
5	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.01

### 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****5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末投资股指期货。

**5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****5.10.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末投资国债期货。

**5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**5.10.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末投资国债期货。

**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	60,513.68

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,536.99
5	应收申购款	3,084,146.28
6	其他应收款	54,290.28
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,205,487.23

#### 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

##### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300104	乐视网	11,708,998.60	2.51	重大资产重组

##### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300583	赛托生物	63,738.78	0.01	新股锁定

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	414,616,646.47
报告期期间基金总申购份额	205,050,162.57
减：报告期期间基金总赎回份额	138,804,663.30
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	480,862,145.74

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 备查文件目录

### 8.1 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》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

## 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 [www.rtfund.com](http://www.rtfund.com) 查询。

融通基金管理有限公司  
2017 年 1 月 20 日