

## 融通创业板指数增强型证券投资基金

## [2012] 第二季度报告

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7月19日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年7月14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2012年4月6日起至6月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称 融通创业板指数

基金主代码 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 约定期开放型

基金合同生效日 2012年4月6日

报告期末基金份额总额 222,028,798.22份

本基金在基金合同规定的范围内，通过严格的投研纪律、科学的投资管理流程，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，通过成立在标的指数中的基础权重构建被动化投资组合，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，力争在跟踪误差范围内，获取超越基准的业绩。

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

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2012年4月6日 - 2012年6月30日)

1.本期已实现收益 5,240,691.70

2.本期利润 1,209,231.50

3.加权平均基金份额本期利润 0.0035

4.期末基金资产净值 217,478,503.27

5.期末基金份额净值 0.980

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；扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益。

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本基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.本基金基金合同生效日为2012年4月6日。

4.基金净值增长率为基金份额净值除以基金份额初始面值。

5.期末基金份额净值

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