

## 融通创业板指数增强型证券投资基金

[2017] 第一季度报告

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:2017年4月21日

§ 1.1 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法律法规的有关规定，于2017年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益损失情况和投资组合报告，确认本报告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，也不保证最低收益。投资人购买基金并不等于其未来表现。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。

本报告期利润2017年1月1日起至3月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称 融通创业板指数增强型证券投资基金  
交易代码 161013  
前端交易代码 161013  
后端交易代码 161013  
赎回交易代码 161013  
基金的运作方式 灵活配置型开放式  
基金合同生效日 2012年4月16日  
报告期末基金资产净值 631,076,430.666  
投资目标 在严格控制风险的前提下，通过股票的投资构建和优化配置的资产组合，实现基金资产的长期增值。

基金资产净值、基金份额净值、每万份基金单位净收益、最近七日年化收益率和投资组合报告等信息可以在基金管理人网站、基金销售机构网站、中国证监会指定报刊上查询。

§ 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(2017年1月1日 - 2017年3月31日)
1.本期已实现收益	-41,164,206.27
2.本期利润	-12,925,590.07
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0262
4.期末基金份额净值	100.496(0.1237)
5.期末基金份额的摊余成本	0.0341

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.本基金所披露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不计费用的收益水平。  
3.2.1 基金本期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(%)	净值增长率标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	①-③	②-④
过去三个月	-2.79%	0.03%	-2.63%	0.02%	-0.16%

3.2.2 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:基金合同生效日为2012年4月16日,图中数据截至2017年3月31日。

图:融通创业板指数增强型证券投资基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较

§ 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 任本基金的基金基金经理 任期日期 说明

赵忠伟 总经理 2016年11月19日 - 担任本基金的基金经理,拥有13年证券从业经验,其中10年基金管理经验,具备丰富的行业研究经验,对新兴产业有深入的研究。

李锐 总经理 2012年4月16日 - 担任本基金的基金经理,拥有13年证券从业经验,其中10年基金管理经验,具备丰富的行业研究经验,对新兴产业有深入的研究。

注:任本基金基金经理时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 管理人对报告期内本基金运作合规性的说明

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、严格履行基金合同的原则谨慎和运用基金资产,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

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公平交易的制度和流程。

4.4 公平交易执行的专项说明

本基金报告期内未发生不公平交易行为。

4.5 报告期内基金投资组合的重大关联交易

本基金报告期内未发生重大关联交易。

4.6 报告期内基金投资组合的偏离度说明

无

## § 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

姓名 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 股权投资 471,631,380.62 93.41

2 固定收益 471,631,380.62 93.41

3 固定收益投资 14,062,000.00 2.97

4 买入返售金融资产 - -

5 贷款类金融资产 - -

6 其他金融资产 - -

7 中长期债券 - -

8 短期投资 - -

9 合计 940,709,380.62 100.00

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 农林牧渔业 - -

B 制造业 60,440,476.40 12.08%

C 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

D 建筑业 110,561.00 0.02%

E 交通运输、仓储和邮政业 66,000.00 0.01%

F 信息传输、软件和信息技术服务业 1,000.00 0.00%

G 公用事业 - -

H 住宿和餐饮业 - -

I 信息技术业 624,620.00 0.16%

J 金融业 - -

K 房地产业 - -

L 相关服务、租赁和商务服务业 - -

M 科学研究、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 61,406,401.22 12.26%

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 交易代码 证券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 002048 丽珠集团 28,850,226.04 5.76%

2 000326 旗滨玻璃 160,769 19,306,121.00 3.07%

3 003014 信维通信 521,000 17,074,360.20 3.03%

4 003056 神宇股份 443,700 16,512,100.00 3.10%

5 000324 旗滨玻璃 13,061,032.00 2.61%

6 000883 光大银行 501,269 12,056,254.00 2.41%

7 002087 飞利达 1,101,034 11,841,001.62 2.37%

8 000113 旗滨玻璃 447,929 11,302,816.72 2.30%

9 000968 蓝光发展 1,233,209 11,269,185.04 2.26%

10 000767 乐凯胶片 628,084 11,103,026.60 2.22%

5.3.2 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

序号 交易代码 证券名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000009 文化长城 672,074 9,533,367.10 1.00%

2 000305 中航电测 160,460 9,321,724.20 1.00%

3 000048 合肥三洋 1,100,000 8,707,326.00 1.74%

4 000340 九号电气 692,716 8,582,761.24 1.71%

5 002021 银泰科技 494,817 7,012,123.03 1.68%

5.4 报告期末按债券品种类型的债券投资组合

序号 债券品种 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国债 14,982,000.00 2.99%

2 中票 1,000,000 0.20%

3 资管计划 1,000,000 0.20%

4 资管计划 1,000,000 0.20%

5 资管计划 1,000,000 0.20%

6 资管计划 1,000,000 0.20%

7 资管计划 1,000,000 0.20%

8 资管计划 1,000,000 0.20%

9 资管计划 1,000,000 0.20%

10 资管计划 1,000,000 0.20%

11 资管计划 1,000,000 0.20%

12 资管计划 1,000,000 0.20%

13 资管计划 1,000,000 0.20%

14 资管计划 1,000,000 0.20%

15 资管计划 1,000,000 0.20%

16 资管计划 1,000,000 0.20%

17 资管计划 1,000,000 0.20%

18 资管计划 1,000,000 0.20%

19 资管计划 1,000,000 0.20%

20 资管计划 1,000,000 0.20%

21 资管计划 1,000,000 0.20%

22 资管计划 1,000,000 0.20%

23 资管计划 1,000,000 0.20%

24 资管计划 1,000,000 0.20%

25 资管计划 1,000,000 0.20%

26 资管计划 1,000,000 0.20%

27 资管计划 1,000,000 0.20%

28 资管计划 1,000,000 0.20%

29 资管计划 1,000,000 0.20%

30 资管计划 1,000,000 0.20%

31 资管计划 1,000,000 0.20%

32 资管计划 1,000,000 0.20%

33 资管计划 1,000,000 0.20%