

# 融通创业板指数增强型证券投资基金 更新招募说明书摘要（2013年第2号）

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

日 期：二〇一三年十一月

## 重要提示

融通创业板指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2011 年 10 月 8 日证监许可[2011]1595 号文核准募集。本基金基金合同于 2012 年 4 月 6 日正式生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉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。

本招募说明书所载内容截止日为 2013 年 9 月 30 日，有关财务数据截止日为 2013 年 9 月 30 日，净值表现截止日为 2012 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。

### 一、基金合同生效日

2012 年 4 月 6 日

### 二、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：融通基金管理有限公司

注册地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

设立日期：2001 年 5 月 22 日

法定代表人：田德军

办公地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

电话：0755-26948070

联系人：敖敬东

基金管理人融通基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2001]8 号文核准设立，注册资本为 12500 万元人民币。目前的股权结构为：新时代证券有限责任公司 60%、日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co., Ltd.）40%。

#### （二）主要人员情况

##### 1、现任董事情况

董事长田德军先生，经济学博士，现任融通基金管理有限公司董事长。历任中信证券股份有限公司投资银行业务主管；上海远东证券有限公司董事长兼总经理；新时代证券有限责任公司总经理。2010 年 3 月至今，任公司董事长。

独立董事杜婕女士，民进会员，注册会计师，现任吉林大学经济学院教授。历任电力部

第一工程局一处主管会计，吉林大学教师、讲师、教授。2011年1月至今，任公司独立董事。

独立董事田利辉先生，金融学博士、执业律师。现任南开大学金融学教授(博士生导师)、金融发展研究院副院长(主持工作)。曾经就读伦敦大学伦敦商学院，执教于密歇根大学WDI研究所、北京大学光华管理学院、长江商学院。2011年1月至今，任公司独立董事。

独立董事施天涛先生，教授。现任清华大学法学院教授、法学院副院长、博士研究生导师、中国证券法学研究会和中国保险法学研究会副会长。2012年1月至今，任公司独立董事。

董事马金声先生，高级经济师。现任新时代证券有限责任公司名誉董事长。历任中国人民银行办公厅副主任、主任，金银管理司司长；中国农业发展银行副行长；国泰君安证券股份有限公司党委书记兼副董事长；华林证券有限责任公司党委书记。2007年至今，任公司董事。

董事奚星华先生，经济学硕士。现任融通基金管理有限公司总经理。历任黑龙江省证券公司宏观行业研究员，北京时代博讯高科技有限公司投资业务副总经理，长财证券经纪有限责任公司总裁，恒泰长财证券有限责任公司执行董事、法定代表人。2012年1月至今，任公司董事。

董事 Frederick Reidenbach (弗莱德)先生，毕业于美国宾夕法尼亚州克兰顿大学，注册会计师。现任日兴资产管理有限公司执行副总裁兼首席财务官和首席营运官。历任日本富达投资首席行政官；富达投资(Fidelity Investment)旗下子公司KVH电信的首席执行长和首席营运官；日本Aon Risk Service的首席财务官和首席营运官。2010年3月至今，任公司董事。

董事 Blair Pickerell (裴布雷)先生，工商管理硕士。现任日兴资产管理香港有限公司亚洲区总裁及全球首席营销总监。历任摩根士丹利亚洲有限公司董事总经理。2012年1月至今，任公司董事。

董事涂卫东先生，法学硕士。现任融通基金管理有限公司督察长。历任国务院法制办公室(原国务院法制局)财金司一处主任科员；中国证监会基金监管部监管一处处级干部；中国证监会公职律师。2009年4月至今，任中共融通基金管理有限公司支部委员会副书记。2010年3月至今，任公司董事。

## 2、现任监事情况

监事李华先生，经济学硕士，现任公司监察稽核部总监。曾任北京大学经济管理系讲师，

1993年起历任广东省南方金融服务总公司基金部副总经理、广东华侨信托投资公司规划发展部总经理、广州鼎源投资理财顾问有限公司总经理兼广东南方资信评估公司董事长、天一证券有限责任公司广州营业部总经理及华南业务总部总经理。2011年至今任公司监事。

### 3、公司高级管理人员情况

总经理奚星华先生，经济学硕士。历任黑龙江省证券公司宏观行业研究员，北京时代博讯高科技有限公司投资业务副总经理，长财证券经纪有限责任公司总裁，恒泰长财证券有限责任公司执行董事、法定代表人。2011年至今任公司总经理。

常务副总经理颜锡廉(Allen Yan)先生，工商管理硕士。历任美国富达投资公司财务分析员、日本富达投资公司财务经理，日兴资产管理有限公司财务企划与分析部部长。2011年至今任公司常务副总经理。

副总经理秦玮先生，工学硕士。历任中国工商银行深圳分行格兰信息咨询公司总经理助理，鹏华基金管理有限公司行政部总监，融通基金管理有限公司登记清算部总监、总经理助理等职务。2009年至今任公司副总经理。

督察长涂卫东先生，法学硕士。历任国务院法制办公室(原国务院法制局)财金司一处主任科员；中国证监会基金监管部监管一处处级干部；中国证监会公职律师。2011年至今任公司督察长。

### 4、基金经理

#### (1) 现任基金经理情况

王建强先生，本科学历，具有证券从业资格，9年证券从业经验。2001年至2004年就职于上海市万得信息技术股份有限公司；2004年至今就职于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，现担任融通深证100指数基金、融通巨潮100指数(LOF)基金和融通深证成份指数基金的基金经理职务。

李勇先生，研究生学历，具有证券从业资格，8年证券从业经验。2005年至今就职于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。现担任融通深证成份指数基金的基金经理职务。

#### (2) 历任基金经理情况

自2012年4月6日起至今，由王建强先生和李勇先生共同担任本基金基金经理。

### 5、投资决策委员会成员

公司投资决策委员会由总经理奚星华先生，常务副总经理颜锡廉(Allen Yan)先生，总经理助理陈晓生先生，基金管理部总监吴巍先生，研究部总监邹曦先生，基金交易部总监

王冰心先生，基金经理郭恒先生组成。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

### 三、基金托管人

#### 1、基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币 349,018,545,827 元

联系电话：010-66105799

联系人：赵会军

#### 2、主要人员情况

截至 2013 年 9 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 179 人，平均年龄 30 岁，95% 以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

#### 3、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2013 年 9 月，中国工商银行共托管证券投资基金 337 只，其中封闭式 5 只，开放式 332 只。自 2003 年以来，本行连续十年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 41 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

### 四、相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

1、直销机构

基金管理人通过在深圳设立的理财中心、在北京和上海设立的分公司以及网上直销为投资者办理开放式基金开户、认购、申购、赎回、基金转换等业务：

(1) 融通基金管理有限公司机构理财部机构销售及深圳小组

地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

邮政编码：518053

联系人：关澜

联系电话：(0755) 26948004

传真：(0755) 26935139

客户服务中心电话：400-883-8088(免长途通话费用)、(0755) 26948088

(2) 融通基金管理有限公司机构理财部机构销售及北京小组

地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 1241-1243 室

邮编：100033

联系人：宋雅萍

联系电话：(010) 66190975

传真：(010) 88091635

(3) 融通基金管理有限公司机构理财部机构销售及上海小组

地址：上海市世纪大道 8 号国金中心汇丰银行大楼 6 楼 601-602

邮编：200120

联系人：居雯莉

联系电话：(021) 38424984

传真：(021) 38424884

(4) 融通基金管理有限公司网上直销

地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

邮政编码：518053

联系人：刘晶

联系电话：(0755) 26948105

传真：(0755) 26948079

2、代销机构

(1) 中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

联系人：杨菲

客服电话：95588

传真：(010) 66107914

(2) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：王洪章

联系人：王琳

客服电话：(010) 66275654；95533

(3) 交通银行股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

联系人：陈铭铭

客服电话：(021) 58781234；95559

(4) 招商银行股份有限公司

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

联系人：邓炯鹏

客服电话：(0755)83198888；95555

(5) 上海银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人：范一飞

联系人：张萍

客服电话：(021)68475888

(6) 深圳平安银行股份有限公司

注册地址：深南中路 1099 号平安银行大厦

办公地址：深南中路 1099 号平安银行大厦

法定代表人：孙建一

客服电话：40066-99999

联系人：霍兆龙

(7) 天相投资顾问有限公司

办公地址：北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

电话：(010) 66045608

联系人：林爽

客服电话：(010) 66045678

(8) 深圳众禄基金销售有限公司

注册地址：中国深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 25 层

办公地址：中国深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 25 层

法定代表人：薛峰

客服电话：4006-788-887

联系人：汤素娅

(9) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

客服电话：400-700-9665

联系人：张茹

(10) 杭州数米基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

客服电话：4000-766-123

联系人：周熾旻

(11) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 楼



办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 楼

法定代表人：张跃伟

客服电话：400-089-1289

联系人：周熾旻

(12) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

法定代表人：万建华

联系人：吴倩

传真：(021) 38676767

客服电话：4008888666

(13) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

法定代表人：王常青

联系人：许梦园

电话：(010) 85130236

客服电话：400-8888-108

(14) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

电话：(020) 87555888-8333

客服电话：95575

(15) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

联系人：宋明

电话：(010) 66568450

客服电话：4008-888-8888

(16) 申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：储晓明

联系人：曹晔

电话：(021) 33388215

客服电话：4008895523

(17) 长江证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市江汉区新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

联系人：孙昊

电话：(027) 68751929

客服电话：95579 或 4008-888-999

(18) 万联证券有限责任公司

注册地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层

法定代表人：张建军

联系人：罗创斌

电话：(020) 38286651

客服电话：400-8888-133

(19) 渤海证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人：杜庆平

联系人：胡天彤

电话：(022) 28451709

客服电话：4006515988

(20) 华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

联系人：庞晓云

电话：(0755) 82492193

客服电话：95597

(21) 东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区翠园路181号商旅大厦17-21层

法定代表人：吴永敏

联系人：王晓虎

电话：(0512) 62938715

客服电话：4008601555

(22) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：高冠江

联系人：唐静

联系电话：(010) 88656476

客服电话：4008008899

(23) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市人民大街1138号

法定代表人：矫正中

联系人：安岩岩

电话：(0431) 85096517

客服电话：4006000686

(24) 新时代证券有限责任公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501

法定代表人：刘汝军

联系人：宋旻

电话：(010) 83561070

客服热线：400-6989-898

(25) 平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：郑舒丽

电话：(0755) 22626391

客服电话：95511-8

(26) 国海证券股份有限公司

注册地址：广西南宁市滨湖路46号

法定代表人：张雅峰

联系人：武斌

联系电话：(0755) 83707413

客服电话：95563

(27) 恒泰证券股份有限公司

注册地址：呼和浩特市新城区东风路 111 号

法定代表人：庞介民

联系人：孙伟

电话：(0471) 4972042

客服电话：(0471) 4961259

(28) 国盛证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦

法定代表人：曾小普

联系人：陈明

电话：(0791) 86281305

客服电话：4008222111

(29) 第一创业证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25F

法定代表人：刘学民

联系人：温丽娜

电话：(010) 63197785

客服电话：4008881888

(30) 华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

电话：(0591) 87383623

客服电话：(0591) 96326

(31) 华龙证券有限责任公司

注册地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼

法定代表人：李晓安

联系人：刘宏波

电话：(0931) 8490208

客服电话：96668

(32) 恒泰长财证券有限责任公司

注册地址：吉林省长春市长江路经济开发区人民大街280号科技城2层A-33段

法定代表人：赵培武

联系人：王楠

电话：(0431) 86702868

客服电话：(0431) 82951765

(33) 深圳众禄诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室

法定代表人：汪静波

联系人：方成

电话：021-38602377

传真：021-38509777

(34) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区峨山路613号6幢551室

办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼

法定代表人：其实

联系人：练兰兰

电话：(021) 54509988

传真：(021) 64383798

(35) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

法定代表人：王莉

电话：0755-82721122-8625

联系人：李延鹏

客服电话：400-920-0022、021-20835588

(36) 北京展恒基金销售有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

法定代表人：闫振杰

联系人：王婉秋

电话：010-62020088

传真：010-62020355

客服电话：400-888-6661

(37) 中期时代基金销售(北京)有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢11层

法人代表：路瑶

电话：400-8888-160

传真：010-59539866

联系人：朱剑林

客服电话：95162、4008888160

(38) 深圳腾元基金销售有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心主楼4F(07)单元

办公地址：深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心主楼4F(07)单元

法定代表人：卓紘晶

联系人：王妮萍

电话：0755-33376853

传真：0755-33065516

客服电话：4006-877-899

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

(二) 注册登记机构

融通基金管理有限公司

办公地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层

设立日期：2001年5月22日

法定代表人：田德军

电话：(0755) 26948071

联系人：杜嘉

### (三) 律师事务所

名称：广东嘉得信律师事务所

注册地址：深圳市红岭中路国信证券大厦12楼

办公地址：深圳市红岭中路国信证券大厦12楼

法定代表人：闵齐双

联系人：尹小胜

经办律师：闵齐双 刘少华 尹小胜 崔卫群

电话：(0755) 33382888 (总机) (0755) 33033020 (直线) 15302728596

传真：(0755) 33033086

### (四) 会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室

办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼(邮编：200021)

法人代表：杨绍信

电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：薛竞、刘莉

经办注册会计师：薛竞、王灵

## 五、基金的名称

融通创业板指数增强型证券投资基金

## 六、基金的类型

契约性开放式

## 七、基金的投资目标

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。

## 八、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。投资于股票资产不低于基金资产净值的90%，其中投资于标的指数成份股、备选成份股

的资产占基金资产的比例不低于 80%，现金及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

如以后法律法规及中国证监会允许基金投资上述品种之外的其他金融工具，本基金可以依照法律法规或监管机构的规定，基金管理人履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

## 九、基金的投资策略

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。

当成份股发生分红、配股、增发等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪业绩比较基准的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪基准指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。

本基金建仓时间为 3 个月，3 个月之后本基金投资组合比例达到《基金合同》的相关规定。

### 1、资产配置

本基金将不低于 80% 的基金资产投资于创业板指数成份股和备选成份股，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%。基金管理人将综合考虑股票市场情况、基金资产的流动性要求等因素确定各类资产的具体配置比例。

本基金将根据市场的实际情况，在基金合同规定的范围内适当调整主动投资部分基金资产的配置比例，以争取实现对标的指数的超越。

### 2、股票组合构建

对指数投资部分，本基金主要采取完全复制法进行投资，即按照创业板指数的成份股组成及权重构建股票投资组合。但是当以下情况发生时，基金管理人将对投资组合进行适当调整，以实现本基金对业绩比较基准的紧密跟踪：(1) 基金管理人预期指数成份股或权重发生变化；(2) 由于市场因素影响、法律法规限制等原因，本基金无法根据指数构建组合；(3) 基金发生申购赎回、成份股派发现金股息等可能影响跟踪效果的情形。

对主动投资部分，本基金依托公司投研团队的研究结论，在结合国内外宏观经济状况，充分把握各个行业景气水平和估值水平的基础上，深入挖掘估值偏低或合理，并且成长性良好的股票品种，进行优选配置，力争获取超额收益。

### 3、股票组合调整

在基金运作过程中，当发生以下情况时，基金管理人将对投资组合进行调整，以降低跟踪误差，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。

(1) 指数编制方法发生变更。基金管理人将评估指数编制方法变更对指数成份股及权



重的影响, 适时进行投资组合调整。

(2) 指数成份股定期或临时调整。基金管理人将预测指数成份股调整方案, 并判断指数成份股调整对投资组合的影响, 在此基础上确定组合调整策略。

(3) 指数成份股出现股本变化、增发、配股、派发现金股息等情形。基金管理人将密切关注这些情形对指数的影响, 并据此确定相应的投资组合调整策略。

(4) 基金发生申购赎回、参与新股申购等影响跟踪效果的情形。基金管理人将分析这些情形对跟踪效果的影响, 据此对投资组合进行相应调整。

(5) 法律法规限制、股票流动性不足、股票停牌等因素导致基金无法根据指数建立组合。基金管理人将根据市场情况, 以跟踪误差最小化为原则对投资组合进行调整。

(6) 根据主动增强策略, 对增强部分头寸进行主动性的调整, 在控制跟踪误差原则下, 增强组合收益。主动增强策略主要为: 本基金依托公司投研团队的研究结论, 在结合国内外宏观经济状况, 充分把握各个行业景气水平和估值水平的基础上, 深入挖掘估值偏低或合理, 并且基本面和成长性良好的股票品种, 进行主动优选配置, 力争获取超额收益。同时, 在对相关证券发行主体的基本面研究的基础上, 综合估值水平、溢价率等指标, 本基金将有选择性地参与一级市场上新股、新债的发行或已上市券种的增发, 力争获取超额收益。

#### 十、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为: 创业板指数收益率 $\times$ 95% + 银行活期存款利率 $\times$ 5%

由于本基金为增强型指数基金, 跟踪标的为创业板指数, 因此本基金采用上述业绩比较基准。

如果创业板指数被停止编制及发布, 或创业板指数由其他指数替代(单纯更名除外), 或由于指数编制方法等重大变更导致创业板指数不宜继续作为本基金的标的指数, 本基金管理人在履行适当程序后, 可以变更基金的标的指数和业绩比较基准, 并在变更前提前 2 个工作日在中国证监会指定的媒体上公告。

#### 十一、基金的风险收益特征

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。

#### 十二、基金投资组合报告

本基金托管人中国工商银行根据本基金合同规定, 于 2013 年 10 月 22 日复核了本报告中的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。

本投资组合报告所载数据截至 2013 年 9 月 30 日, 报告期为 2013 年 7 月 1 日至 2013 年 9 月 30 日。本报告中所列财务数据未经审计。

##### 12.1 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	56,861,100.36	93.08
	其中:股票	56,861,100.36	93.08
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	3,447,567.67	5.64
6	其他资产	781,596.80	1.28
7	合计	61,090,264.83	100.00

## 12.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 12.2.1 报告期末指数投资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	采掘业	594,690.53	0.98
C	制造业	26,890,597.53	44.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,118,521.06	1.85
F	批发和零售业	244,061.65	0.40
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	12,321,430.57	20.40
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,609,523.00	4.32
M	科学研究和技术服务业	988,729.83	1.64
N	水利、环境和公共设施管理业	3,558,775.24	5.89
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	588,807.57	0.97
R	文化、体育和娱乐业	7,688,979.78	12.73
S	综合	-	-
	合计	56,604,116.76	93.73

## 12.2.2 报告期末积极投资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	采掘业	-	-
C	制造业	256,983.60	0.43
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	-	-
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	256,983.60	0.43

## 12.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

## 12.3.1 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	300027	华谊兄弟	55,584	4,328,881.92	7.17
2	300070	碧水源	63,194	2,571,995.80	4.26
3	300058	蓝色光标	37,149	2,488,983.00	4.12
4	300104	乐视网	50,794	1,617,280.96	2.68
5	300002	神州泰岳	40,592	1,559,138.72	2.58
6	300133	华策影视	36,204	1,465,899.96	2.43
7	300024	机器人	33,288	1,462,674.72	2.42
8	300059	东方财富	65,646	1,406,793.78	2.33
9	300251	光线传媒	21,595	1,398,060.30	2.31
10	300315	掌趣科技	48,911	1,366,573.34	2.26

## 12.3.2 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	300028	金亚科技	27,933	256,983.60	0.43

## 12.4 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。

## 12.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 12.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

## 12.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

12.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

12.8.1 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。

12.8.2 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。

12.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

12.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

12.9.2 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。

12.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

12.10 投资组合报告附注

12.10.1 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。

12.10.2 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。

12.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	23,150.56
2	应收证券清算款	11,748.58
3	应收股利	-
4	应收利息	606.27
5	应收申购款	746,091.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	781,596.80

12.10.4 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。

12.10.5 报告期末股票中存在流通受限情况的说明

12.10.5.1 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	1,617,280.96	2.68	重大事项停牌
2	300315	掌趣科技	1,366,573.34	2.26	重大事项停牌

## 12.10.5.2 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

本基金本报告期末积极投资部分前十名股票中不存在流通受限情况。

### 十三、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日为2012年4月6日。自基金合同生效以来，本基金基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较如下：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2012年4月6日至2012年12月31日	-2.78%	1.24%	2.31%	1.42%	-5.09%	-0.18%
2013年上半年	39.39%	1.87%	39.42%	1.83%	-0.03%	0.04%

### 十四、费用概览

#### (一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

#### (二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述(一)基金费用的种类中第 3—8 项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

### (三) 不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
- 3、《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### (四) 费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种指定媒体和基金管理人网站

上公告。

(五) 与基金销售有关的费用

(1) 申购费率

前端申购费率：

申购金额 (M)	前端申购费率
M < 100万	1.20%
100万 ≤ M < 500万	0.80%
M ≥ 500万	单笔1000元

后端申购费率：

持有时间 (T)	后端申购费率
T < 1年	1.50%
1年 ≤ T < 2年	1.12%
2年 ≤ T < 3年	0.75%
3年 ≤ T < 4年	0.37%
T ≥ 4年	0

基金份额每多持有一年，其后端申购费率按 25%递减，最低为零，精确到小数点后四位，小数点后第五位舍去。

注：上表中，1 年以 365 天计算。

(2) 本基金的赎回费率

持有时间 (T)	赎回费率
T < 1年	0.50%
1年 ≤ T < 2年	0.25%
T ≥ 2年	0

注：上表中，1 年以 365 天计算。

本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，赎回费总金额的 25%归基金财产所有，其余部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施日前 2 个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站上刊登公告。

基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

## 十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《基金法》、《运作管理办法》、《销售管理办法》、《信息披露管理办

法》及其他有关法律法规的要求,对本基金管理人于2013年5月15日刊登的本基金更新招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

一、在“一、释义”部分,对《基金法》、《销售办法》、基金资产总值和基金资产净值的释义进行了更新。

二、在“三、基金管理人”部分,对“(二)主要人员情况”部分进行了更新。

三、在“四、基金托管人”中,更新了“(一)基金托管人情况”和“(二)基金托管人的内部控制制度”的相关信息;

四、在“五、相关服务机构”中,“(一)基金份额发售机构”部分更新了部分直销机构相关信息;更新了部分代销机构的相关信息;新增和讯信息科技有限公司、北京展恒基金销售有限公司、中期时代基金销售(北京)有限公司和深圳腾元基金销售有限公司为本基金的代销机构;

五、在“九、基金的投资”部分,更新了“(十二)基金投资组合报告”的内容,数据为本基金2013年3季度报告中的投资组合数据;

六、更新了“十、基金的业绩”部分,列示了自基金合同生效日以来至2013年6月30日止的投资业绩数据;

七、在“二十四、其他应披露的事项”部分,对本报告期内的基金公告进行了列表说明。

融通基金管理有限公司

2013年11月15日