

# 融通创业板指数增强型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 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

送出日期：2016 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据融通创业板指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同规定，于 2016 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>11</b>
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	15
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>30</b>
7.1 期末基金资产组合情况	30
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	30
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	36
7.6 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	36
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	36
7.8 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贵金属投资明细	36
7.9 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	36
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	36
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	37
7.12 投资组合报告附注	37

<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>38</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	38
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	38
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>38</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>38</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	38
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	38
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	39
10.4 基金投资策略的改变 .....	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	39
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	39
10.8 其他重大事件 .....	40
<b>§ 11 备查文件目录</b> .....	<b>42</b>

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	融通创业板指数增强型证券投资基金
基金简称	融通创业板指数
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	387,835,297.46 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		融通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	涂卫东	洪渊
	联系电话	(0755) 26948666	(010) 66105799
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-883-8088、(0755) 26948088	95588
传真		(0755) 26935005	(010) 66105798
注册地址		深圳市南山区华侨城汉唐	北京市西城区复兴门内大街 55

	大厦 13、14 层	号
办公地址	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518053	100140
法定代表人	高峰	易会满

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.rtfund.com">http://www.rtfund.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	融通基金管理有限公司	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-23,825,191.49
本期利润	-46,938,677.14
加权平均基金份额本期利润	-0.1295
本期加权平均净值利润率	-12.34%
本期基金份额净值增长率	-16.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-15,465,009.47
期末可供分配基金份额利润	-0.0399
期末基金资产净值	425,304,219.84
期末基金份额净值	1.097
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	163.03%

注：(1) 所述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；

(2) 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；

(3) 期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润

的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

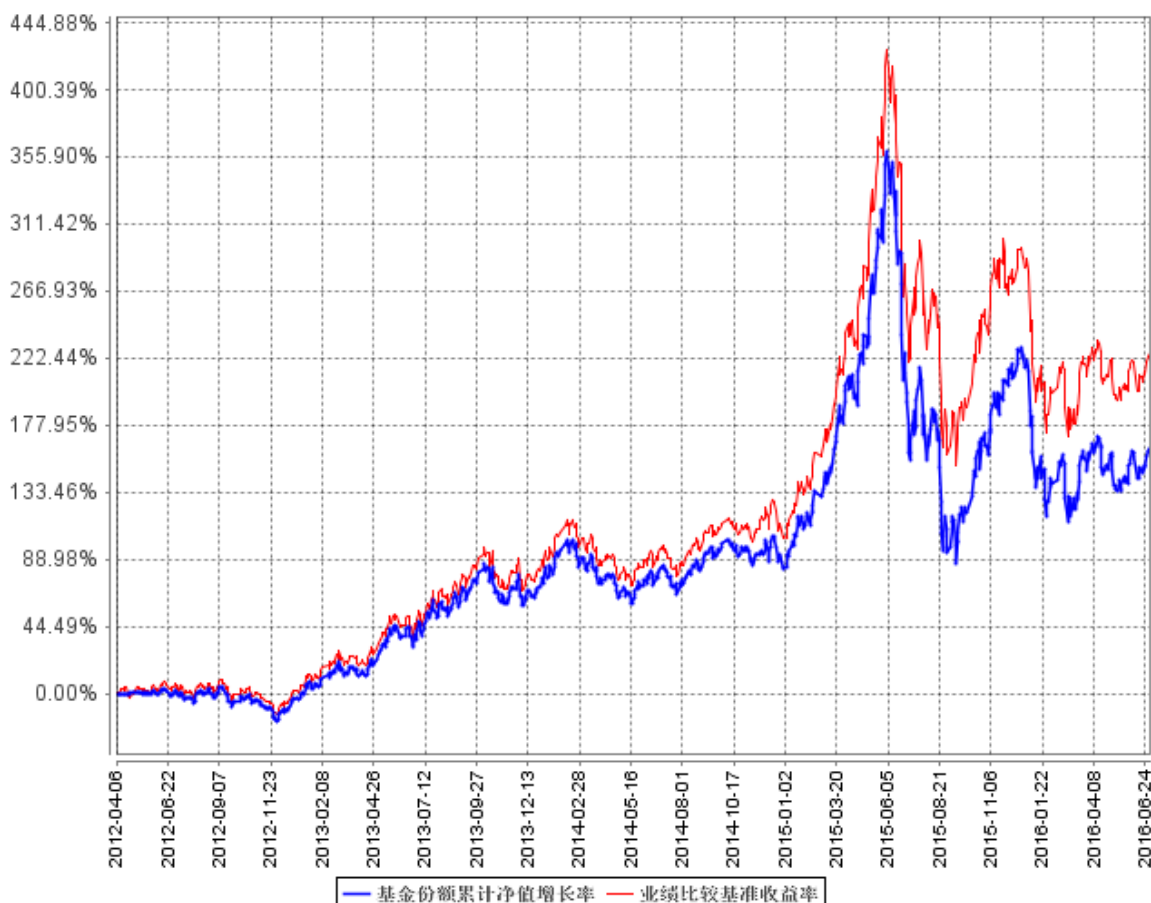
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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	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
过去一个月	4.58%	1.91%	3.55%	1.84%	1.03%	0.07%
过去三个月	1.76%	2.00%	1.21%	1.88%	0.55%	0.12%
过去六个月	-16.06%	2.91%	-14.21%	2.70%	-1.85%	0.21%
过去一年	-19.22%	3.27%	-15.37%	3.00%	-3.85%	0.27%
过去三年	94.09%	2.51%	128.30%	2.37%	-34.21%	0.14%
自基金合同生效起至今	163.03%	2.26%	225.64%	2.18%	-62.61%	0.08%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

融通基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证监会证监基字[2001]8号文批准，于2001年5月22日成立，公司注册资本12500万元人民币。本公司的股东及其出资比例为：新时代证券股份有限公司60%、日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co., Ltd.）40%。

截至2016年6月30日，公司管理的基金共有四十五只：一只封闭式基金，即融通通乾封闭基金；四十四只开放式基金，即融通新蓝筹混合基金、融通债券基金、融通深证100指数基金、融通蓝筹成长混合基金、融通行业景气混合基金、融通巨潮100指数基金（LOF）、融通易支付货币基金、融通动力先锋股票基金、融通领先成长混合基金（LOF）、融通内需驱动混合基金、融通深证成份指数基金、融通四季添利债券基金、融通创业板指数基金、融通医疗保健混合基金、融通岁岁添利定期开放债券基金、融通丰利四分法（QDII-FOF）基金、融通汇财宝货币市场基金、融通标普中国可转债指数增强基金、融通通泰保本混合基金、融通通泽混合基金、融通通福分级债券基金、融通通源短融债券基金、融通通瑞债券基金、融通月月添利基金、融通健康产业混合基金、融通转型三动力混合基金、融通互联网传媒混合基金、融通新区域新经济混合基金、融通通鑫混合基金、融通新能源混合基金、融通军工分级指数基金、融通证券分级指数基金、融通农业分级指数基金、融通跨界成长混合基金、融通新机遇混合基金、融通成长30混合基金、融通中国风1号混合基金、融通通盈保本混合基金、融通增利债券基金、融通增裕债券基金、融通增鑫债券基金、融通增益债券基金、融通增祥债券基金和融通新消费混合基金。其中，融通债券基金、融通深证100指数基金和融通蓝筹成长混合基金同属融通通利系列证券投资基金。此外，公司还开展了特定客户资产管理业务。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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	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



	指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理			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。
--	----------------------	--	--	---

注： 1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 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，本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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。

本基金管理人对报告期内不同时间窗下（日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析，各投资组合的同向交易价差均处于合理范围之内。

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 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。

##### 4.4.2 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-16.06%，同期业绩比较基准收益率为-14.21%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前经济下行压力仍未消除，但在稳增长的支撑下，出现失速下滑的风险降低。在此背景下，我们看到政策在改革转型方面正有序的不断推进，尤其是供给侧改革正不断取得突破，与此同时，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。另一方面，海外风险因素仍将持续出现，考虑到美联储加息行为与市场存在反身性，而当前全球经济包括美国自身的经济景气的疲软，其加息行为的影响涉及面过大也过于复杂，因而在经济和政策前景不明确前，市场对加息路径及其概率的预期将出现反复。此外，英国脱欧的中长期影响也难以预测。综合来看，当前国内经济、政策因素正逐渐趋于平稳，而美联储加息等海外风险因素将加大干扰，且同时考虑到全球经济面临的困境以及中国经济本身的下行压力，要警惕中长期里宽松政策带来的通胀风险。

总体来看，市场会随着美元加息预期变化、国内经济下行压力和稳增长政策力度的变化出现反复，但在货币宽松方向不出现根本改变的局面下，市场的主题和热点的仍将会不断出现和频繁切换，结构性行情仍能持续：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等将受益；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、区块链、人工智能、以及军工电子等都存在阶段性的结构性机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照《融通基金管理有限公司证券投资基金估值业务原则和程序》进行，公司设立由研究部、风险管理部、登记清算部、固定收益部、国际业务部和监察稽核部共同组成的估值委员会，通过参考行业协会估值意见、参考独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员不包含基金经理。

估值委员会定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经公司总经理办公会议审批后方可实施。基金在采用新投资策略或投资新品种时，应评价现有估值政策和程序的适用性。其中研究部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，金融工程小组负责估值方法的研究、价格的计算及复核，登记清算部进行具体的估值核算并计算每日基金净值，每日对基金所投资品种的公开信息、基金会计估值方法的法规等进行搜集并整理汇总，供估值委员会参考，监察稽核部负责基金估值业务的事前、

事中及事后的审核工作。基金经理不参与估值决定，参与估值流程各方之间亦不存在任何重大利益冲突，截至报告期末公司未与外部估值定价服务机构签约。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人于 2016 年 3 月 8 日实施利润分配,以 2016 年 2 月 24 日的可分配收益为基准,每 10 份基金份额派发现金红利 0.50 元。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对融通创业板指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，融通创业板指数增强型证券投资基金的管理人——融通管理有限公司在融通创业板指数增强型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，融通创业板指数增强型证券投资基金实施利润分配的金额为 17,495,990.25 元。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对融通基金管理有限公司编制和披露的融通创业板指数增强型证券投资基金 2016 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：融通创业板指数增强型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	37,540,661.13	26,964,252.99
结算备付金		1,271,492.53	55,749.52
存出保证金		179,735.65	97,485.26
交易性金融资产	6.4.7.2	403,360,962.57	336,585,543.95
其中：股票投资		403,360,962.57	336,585,543.95
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		4,082,647.90	-
应收利息	6.4.7.5	5,722.92	5,538.40
应收股利		-	-
应收申购款		4,353,560.99	12,633,964.54
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	54,290.28	54,290.28
资产总计		450,849,073.97	376,396,824.94
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	7,683,717.43
应付赎回款		24,360,436.18	8,387,584.60
应付管理人报酬		356,636.36	408,151.89
应付托管费		71,327.27	81,630.39
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	547,547.47	401,184.53
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	208,906.85	75,536.20
负债合计		25,544,854.13	17,037,805.04
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	387,835,297.46	260,918,886.49
未分配利润	6.4.7.10	37,468,922.38	98,440,133.41
所有者权益合计		425,304,219.84	359,359,019.90

负债和所有者权益总计		450,849,073.97	376,396,824.94
------------	--	----------------	----------------

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.097 元，基金份额总额 387,835,297.46 份。

## 6.2 利润表

会计主体：融通创业板指数增强型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-43,216,721.19	73,364,376.48
1. 利息收入		127,322.47	113,806.94
其中：存款利息收入	6.4.7.11	127,322.47	113,806.94
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		-20,942,620.02	43,939,081.99
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-21,965,934.60	43,554,643.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,023,314.58	384,438.54
3. 公允价值变动收益	6.4.7.17	-23,113,485.65	28,313,174.35
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	6.4.7.18	712,062.01	998,313.20
<b>减：二、费用</b>		3,721,955.95	1,825,809.20
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,887,372.86	987,724.51
2. 托管费	6.4.10.2.2	377,474.55	197,544.92
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,317,091.74	559,461.71
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	140,016.80	81,078.06
<b>三、利润总额</b>		-46,938,677.14	71,538,567.28
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润</b>		-46,938,677.14	71,538,567.28

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通创业板指数增强型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	260,918,886.49	98,440,133.41	359,359,019.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-46,938,677.14	-46,938,677.14
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	126,916,410.97	3,463,456.36	130,379,867.33
其中：1. 基金申购款	667,333,559.30	33,890,935.71	701,224,495.01
2. 基金赎回款	-540,417,148.33	-30,427,479.35	-570,844,627.68
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-17,495,990.25	-17,495,990.25
五、期末所有者权益（基金净值）	387,835,297.46	37,468,922.38	425,304,219.84
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	90,099,515.45	15,264,693.01	105,364,208.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	71,538,567.28	71,538,567.28
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	5,082,525.64	14,812,744.26	19,895,269.90
其中：1. 基金申购款	423,651,142.39	412,152,432.75	835,803,575.14
2. 基金赎回款	-418,568,616.75	-397,339,688.49	-815,908,305.24
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	95,182,041.09	101,616,004.55	196,798,045.64

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>孟朝霞</u>	<u>颜锡廉</u>	<u>刘美丽</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

融通创业板指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2011]第 1595 号《关于核准融通创业板指数增强型证券投资基金募集的批复》核准,由融通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通创业板指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 487,249,190.89 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 084 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《融通创业板指数增强型证券投资基金基金合同》于 2012 年 4 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 487,321,720.94 份基金份额,其中认购资金利息折合 72,530.05 份基金份额。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通创业板指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,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%。本基金的业绩比较基准为:创业板指数收益率 $\times$ 95% + 银行活期存款利率 $\times$ 5%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《融通创业板指数增强型证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操

作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继



续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
活期存款	37,540,661.13
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	37,540,661.13

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	409,404,379.15	403,360,962.57	-6,043,416.58
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	409,404,379.15	403,360,962.57	-6,043,416.58

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.4 买入返售金融资产

###### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末各项买入返售金融资产余额均为零。

###### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

## 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	5,135.13
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	514.98
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	72.81
合计	5,722.92

## 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
其他应收款	54,290.28
待摊费用	-
合计	54,290.28

## 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	547,547.47
银行间市场应付交易费用	-
合计	547,547.47

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	87,076.05
预提费用	121,830.80
应付后端申购费	-
合计	208,906.85

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	260,918,886.49	260,918,886.49
本期申购	667,333,559.30	667,333,559.30
本期赎回(以“-”号填列)	-540,417,148.33	-540,417,148.33
本期末	387,835,297.46	387,835,297.46

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	20,130,559.46	78,309,573.95	98,440,133.41
本期利润	-23,825,191.49	-23,113,485.65	-46,938,677.14
本期基金份额交易产生的变动数	5,725,612.81	-2,262,156.45	3,463,456.36
其中：基金申购款	3,882,898.35	30,008,037.36	33,890,935.71
基金赎回款	1,842,714.46	-32,270,193.81	-30,427,479.35
本期已分配利润	-17,495,990.25	-	-17,495,990.25
本期末	-15,465,009.47	52,933,931.85	37,468,922.38

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	8,010.48
其他	26,784.16
合计	127,322.47

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
	卖出股票成交总额
减：卖出股票成本总额	423,846,465.16
买卖股票差价收入	-21,965,934.60

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资产生的收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期无贵金属投资产生的收益/损失。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具投资产生的收益/损失。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,023,314.58
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,023,314.58

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-23,113,485.65
——股票投资	-23,113,485.65
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-23,113,485.65

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	563,839.17
转换费分成	148,222.84
合计	712,062.01

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的25%归入基金资产。

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
----	----------------------------

交易所市场交易费用	1,317,091.74
银行间市场交易费用	-
合计	1,317,091.74

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	22,376.90
信息披露费	99,453.90
银行费用	186.00
债券帐户维护费	18,000.00
合计	140,016.80

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需要作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
融通基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
新时代证券股份有限公司（“新时代证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元发生交易。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,887,372.86	987,724.51
其中：支付销售机构的客户维护费	1,402,469.07	389,909.28

注：1、支付基金管理人融通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

2、客户维护费是基金管理人与基金销售机构约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的费用，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	377,474.55	197,544.92

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，基金管理人主要股东及其控制的机构均未持有本基金份额。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	37,540,661.13	92,527.83	36,480,363.28	58,918.41

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金本报告期及上年度可比期间均未买入管理人、托管人的控股股东在承销期内担任副主承销商或分销商所承销的证券；

2、本基金本报告期及上年度可比期间均未买入管理人、托管人的主要股东（非控股）在承销期内承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项的说明。

#### 6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2016年3月8日	2016年3月8日	0.5000	11,283,025.59	6,212,964.66	17,495,990.25	
合计	-	-	0.5000	11,283,025.59	6,212,964.66	17,495,990.25	

#### 6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300520	科大国创	2016年6月30日	2016年7月8日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-

002805	丰元股份	2016年6月29日	2016年7月7日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-
--------	------	------------	-----------	--------	------	------	-----	----------	----------	---

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300032	金龙机电	2016年6月28日	非公开发行股票停牌	20.10	2016年7月7日	19.80	123,217	2,573,109.20	2,476,661.70	-
300052	中青宝	2016年6月8日	重大资产重组	22.03	-	-	108,689	2,512,510.37	2,394,418.67	-
300142	沃森生物	2016年3月22日	重大资产重组	8.14	-	-	262,942	2,916,862.56	2,140,347.88	-
300300	汉鼎宇佑	2016年5月10日	重大资产重组	30.56	-	-	51,752	1,389,367.07	1,581,541.12	-
300166	东方国信	2016年6月8日	重大资产重组	27.47	-	-	51,013	1,478,785.74	1,401,327.11	-
300413	快乐购	2016年6月20日	重大资产重组	24.35	-	-	32,400	1,137,360.45	788,940.00	-

注：本基金截至 2016 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因从事银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。



#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因从事交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，主要投资于创业板指数成份股和备选成份股。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行建设全面风险管理体系、风控优先的政策，在董事会下设立合规与审计委员会，主要负责公司运行合规性的监督、核查以及公司内外部审计的沟通、监督和核查工作。委员会对董事会负责；在管理层层面设立风险控制委员会，负责建立健全公司的风险管理制度并组织实施，审定公司的业务风险管理政策，审定公司内控管理组织实施方案，审定公司的业务授权方案，审定基金资产组合的风险状况评价分析报告，审定公司各项风险与内控状况评价报告，审定业务风险损失责任人的责任，审定重大业务可行性风险论证，协调突发性重大风险事件的处理；各业务部门在执行业务事项时需遵守相关法律法规，遵守公司业务管理制度，具有根据业务特点控制业务风险的职责。业务人员是风险控制环节的直接责任人，部门负责人是控制业务风险管理的第一责任人，对部门风险控制措施的实施情况进行管理；风险管理小组由总经理办公会决定的投资专业人员和金融工程人员组成，负责制定相关业务风险的识别和度量方法，指导业务部门实施风险的管理和控制，并定期出具投资组合风险报告，进行投资风险分析与绩效评估；督察长和监察稽核部负责监察公司各业务部门在相关法律法规、规章制度和业务流程执行方面的情况，确保既定的风险控制措施得到有效的贯彻执行，发现内控缺失和管理漏洞，提出改进要求和建议，并报告法规和制度的执行情况。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人

出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。（2015 年 12 月 31 日：同）

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持的全部证券在证券交易所上市，因此除附注 6.4.11 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	37,540,661.13	-	-	-	37,540,661.13
结算备付金	1,271,492.53	-	-	-	1,271,492.53
存出保证金	179,735.65	-	-	-	179,735.65
交易性金融资产	-	-	-	403,360,962.57	403,360,962.57
衍生金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	4,082,647.90	4,082,647.90
应收申购款	2,018,372.76	-	-	2,335,188.23	4,353,560.99
应收利息	-	-	-	5,722.92	5,722.92
待摊费用	-	-	-	-	-
其他应收款	-	-	-	54,290.28	54,290.28
资产总计	41,010,262.07	-	-	409,838,811.90	450,849,073.97
负债					
卖出回购金融资产	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	24,360,436.18	24,360,436.18
应付管理人报酬	-	-	-	356,636.36	356,636.36
应付托管费	-	-	-	71,327.27	71,327.27
应付交易费用	-	-	-	547,547.47	547,547.47
其他负债	-	-	-	208,906.85	208,906.85

负债总计	-	-	-	25,544,854.13	25,544,854.13
利率敏感度缺口	41,010,262.07	-	-	384,293,957.77	425,304,219.84
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	26,964,252.99	-	-	-	26,964,252.99
结算备付金	55,749.52	-	-	-	55,749.52
存出保证金	97,485.26	-	-	-	97,485.26
交易性金融资产	-	-	-	336,585,543.95	336,585,543.95
应收利息	-	-	-	5,538.40	5,538.40
应收申购款	4,081,613.27	-	-	8,552,351.27	12,633,964.54
其他资产	-	-	-	54,290.28	54,290.28
资产总计	31,199,101.04	-	-	345,197,723.90	376,396,824.94
负债					
应付证券清算款	-	-	-	7,683,717.43	7,683,717.43
应付赎回款	-	-	-	8,387,584.60	8,387,584.60
应付管理人报酬	-	-	-	408,151.89	408,151.89
应付托管费	-	-	-	81,630.39	81,630.39
应付交易费用	-	-	-	401,184.53	401,184.53
其他负债	-	-	-	75,536.20	75,536.20
负债总计	-	-	-	17,037,805.04	17,037,805.04
利率敏感度缺口	31,199,101.04	-	-	328,159,918.86	359,359,019.90

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2015 年 12 月 31 日:同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金运用指数化投资方式，通过控制股票投资组合与创业板指数的跟踪误差，力求实现对

创业板指数的有效跟踪。金融工程小组负责对基金组合的跟踪误差和风险进行评估，定期提交组合跟踪误差和风险监控报告。在跟踪误差超过一定范围时，通知基金经理和相关部门，及时进行投资组合的调整。投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施。监察稽核部对投资的决策和执行过程进行日常监督。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	403,360,962.57	94.84	336,585,543.95	93.66
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	403,360,962.57	94.84	336,585,543.95	93.66

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除创业板指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	1. 创业板指数上升 5%	21,690,515.21	17,979,398.56
2. 创业板指数下降 5%	-21,690,515.21	-17,979,398.56	

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	403,360,962.57	89.47
	其中：股票	403,360,962.57	89.47
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	38,812,153.66	8.61
7	其他各项资产	8,675,957.74	1.92
8	合计	450,849,073.97	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	4,929,034.92	1.16
B	采矿业	-	-
C	制造业	150,278,608.34	35.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,909,124.64	1.15
F	批发和零售业	788,940.00	0.19
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	169,098,524.63	39.76
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	9,149,461.28	2.15
M	科学研究和技术服务业	2,706,837.48	0.64
N	水利、环境和公共设施管理业	8,996,998.56	2.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	13,653,780.19	3.21
R	文化、体育和娱乐业	38,701,831.81	9.10
S	综合	-	-
	合计	403,213,141.85	94.81

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	77,328.32	0.02
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	70,492.40	0.02
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	147,820.72	0.03

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 7.3.1 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300104	乐视网	404,467	21,400,348.97	5.03
2	300059	东方财富	843,557	18,726,965.40	4.40
3	300017	网宿科技	192,244	12,918,796.80	3.04
4	300024	机器人	443,279	11,254,853.81	2.65

5	300027	华谊兄弟	751,081	10,169,636.74	2.39
6	300070	碧水源	604,637	8,996,998.56	2.12
7	300431	暴风集团	123,352	8,943,020.00	2.10
8	300336	新文化	310,484	7,755,890.32	1.82
9	300124	汇川技术	398,792	7,736,564.80	1.82
10	300408	三环集团	427,502	7,677,935.92	1.81
11	300315	掌趣科技	728,655	7,643,590.95	1.80
12	300003	乐普医疗	412,264	7,519,695.36	1.77
13	300133	华策影视	469,174	7,305,039.18	1.72
14	300168	万达信息	277,366	7,208,742.34	1.69
15	300072	三聚环保	225,619	6,236,109.16	1.47
16	300033	同花顺	72,803	5,929,804.35	1.39
17	300295	三六五网	177,050	5,754,125.00	1.35
18	300113	顺网科技	149,271	5,666,327.16	1.33
19	300253	卫宁健康	227,079	5,608,851.30	1.32
20	300011	鼎汉技术	238,278	5,592,384.66	1.31
21	300058	蓝色光标	573,808	5,571,675.68	1.31
22	300079	数码视讯	642,271	5,504,262.47	1.29
23	300144	宋城演艺	205,508	5,119,204.28	1.20
24	300498	温氏股份	136,086	4,929,034.92	1.16
25	300055	万邦达	269,584	4,909,124.64	1.15
26	300015	爱尔眼科	132,135	4,826,891.55	1.13
27	300418	昆仑万维	168,684	4,768,696.68	1.12
28	300267	尔康制药	330,344	4,730,526.08	1.11
29	300347	泰格医药	162,121	4,704,751.42	1.11
30	300146	汤臣倍健	342,649	4,639,467.46	1.09
31	300136	信维通信	216,080	4,529,036.80	1.06
32	300251	光线传媒	381,676	4,412,174.56	1.04
33	300367	东方网力	176,336	4,378,422.88	1.03
34	300085	银之杰	145,820	4,360,018.00	1.03
35	300182	捷成股份	252,908	4,327,255.88	1.02
36	300324	旋极信息	196,900	4,225,474.00	0.99
37	300271	华宇软件	221,096	4,183,136.32	0.98
38	300244	迪安诊断	124,989	4,122,137.22	0.97
39	300115	长盈精密	198,283	4,084,629.80	0.96
40	300156	神雾环保	193,900	3,990,462.00	0.94
41	300291	华录百纳	167,441	3,939,886.73	0.93
42	300001	特锐德	170,008	3,687,473.52	0.87
43	300352	北信源	197,403	3,685,514.01	0.87



44	300383	光环新网	96,791	3,668,378.90	0.86
45	300088	长信科技	245,124	3,644,993.88	0.86
46	300178	腾邦国际	186,343	3,577,785.60	0.84
47	300231	银信科技	190,290	3,508,947.60	0.83
48	300226	上海钢联	66,895	3,371,508.00	0.79
49	300199	翰宇药业	165,558	3,369,105.30	0.79
50	300159	新研股份	185,100	3,341,055.00	0.79
51	300043	互动娱乐	230,082	3,260,261.94	0.77
52	300010	立思辰	154,235	3,235,850.30	0.76
53	300170	汉得信息	210,230	3,191,291.40	0.75
54	300134	大富科技	102,161	3,060,743.56	0.72
55	300077	国民技术	152,760	3,024,648.00	0.71
56	300216	千山药机	95,498	3,020,601.74	0.71
57	300287	飞利信	221,234	2,964,535.60	0.70
58	300203	聚光科技	110,396	2,914,454.40	0.69
59	300207	欣旺达	112,830	2,896,346.10	0.68
60	300333	兆日科技	113,829	2,709,130.20	0.64
61	300147	香雪制药	183,914	2,709,053.22	0.64
62	300012	华测检测	218,646	2,706,837.48	0.64
63	300229	拓尔思	125,865	2,690,993.70	0.63
64	300090	盛运环保	325,093	2,630,002.37	0.62
65	300274	阳光电源	102,103	2,491,313.20	0.59
66	300032	金龙机电	123,217	2,476,661.70	0.58
67	300188	美亚柏科	92,421	2,462,095.44	0.58
68	300096	易联众	131,830	2,417,762.20	0.57
69	300238	冠昊生物	54,810	2,405,062.80	0.57
70	300052	中青宝	108,689	2,394,418.67	0.56
71	300004	南风股份	112,803	2,210,938.80	0.52
72	300039	上海凯宝	212,965	2,165,854.05	0.51
73	300005	探路者	126,704	2,160,303.20	0.51
74	300142	沃森生物	262,942	2,140,347.88	0.50
75	300257	开山股份	123,044	2,032,686.88	0.48
76	300288	朗玛信息	53,900	1,954,414.00	0.46
77	300171	东富龙	99,338	1,875,501.44	0.44
78	300369	绿盟科技	43,997	1,861,513.07	0.44
79	300068	南都电源	82,547	1,804,477.42	0.42
80	300122	智飞生物	109,160	1,688,705.20	0.40
81	300152	科融环境	217,600	1,640,704.00	0.39
82	300339	润和软件	44,489	1,594,485.76	0.37

83	300300	汉鼎宇佑	51,752	1,581,541.12	0.37
84	300026	红日药业	88,894	1,545,866.66	0.36
85	300228	富瑞特装	88,308	1,501,236.00	0.35
86	300433	蓝思科技	51,911	1,459,737.32	0.34
87	300166	东方国信	51,013	1,401,327.11	0.33
88	300212	易华录	45,994	1,369,241.38	0.32
89	300205	天喻信息	83,867	1,240,392.93	0.29
90	300276	三丰智能	47,400	998,244.00	0.23
91	300020	银江股份	47,170	877,362.00	0.21
92	300413	快乐购	32,400	788,940.00	0.19
93	300273	和佳股份	40,764	780,630.60	0.18
94	300078	思创医惠	23,300	779,152.00	0.18
95	300252	金信诺	19,300	639,409.00	0.15
96	300202	聚龙股份	21,992	532,426.32	0.13
97	300002	神州泰岳	46,133	490,855.12	0.12
98	300053	欧比特	15,050	273,157.50	0.06
99	300101	振芯科技	97	2,709.21	0.00
100	300075	数字政通	86	2,205.90	0.00

### 7.3.2 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.01
2	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.01
3	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.01
4	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
5	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300295	三六五网	15,814,243.88	4.40
2	300336	新文化	11,758,110.25	3.27
3	300052	中青宝	11,198,719.51	3.12
4	300017	网宿科技	10,356,215.14	2.88

5	300431	暴风集团	10,326,800.26	2.87
6	300136	信维通信	9,203,851.34	2.56
7	300133	华策影视	8,929,415.02	2.48
8	300059	东方财富	8,926,633.37	2.48
9	300134	大富科技	8,908,502.91	2.48
10	300011	鼎汉技术	8,878,015.70	2.47
11	300027	华谊兄弟	8,768,618.77	2.44
12	300408	三环集团	8,470,294.57	2.36
13	300418	昆仑万维	8,240,164.18	2.29
14	300276	三丰智能	8,036,058.00	2.24
15	300058	蓝色光标	8,011,867.41	2.23
16	300113	顺网科技	7,578,554.44	2.11
17	300088	长信科技	7,542,911.20	2.10
18	300090	盛运环保	7,466,650.71	2.08
19	300079	数码视讯	7,319,224.20	2.04
20	300216	千山药机	7,122,103.82	1.98

注：“买入金额”是指买入股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300295	三六五网	11,611,060.56	3.23
2	300134	大富科技	9,704,899.00	2.70
3	300052	中青宝	9,566,766.53	2.66
4	300136	信维通信	9,107,559.21	2.53
5	300276	三丰智能	8,193,718.14	2.28
6	300088	长信科技	7,595,885.01	2.11
7	300216	千山药机	7,104,862.58	1.98
8	300202	聚龙股份	7,048,572.73	1.96
9	300090	盛运环保	6,635,369.74	1.85
10	300017	网宿科技	6,249,454.21	1.74
11	300122	智飞生物	6,191,479.92	1.72
12	300113	顺网科技	5,968,258.23	1.66
13	300058	蓝色光标	5,859,825.04	1.63
14	300205	天喻信息	5,535,371.00	1.54
15	300075	数字政通	5,337,833.60	1.49

16	300011	鼎汉技术	5,315,521.51	1.48
17	300433	蓝思科技	5,274,743.11	1.47
18	300068	南都电源	5,243,497.76	1.46
19	300291	华录百纳	5,140,503.66	1.43
20	300228	富瑞特装	5,076,089.29	1.41

注：“卖出金额”是指卖出股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	513,735,369.43
卖出股票收入（成交）总额	401,880,530.56

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”均按成交单价乘以成交数量填列，相关交易费用不考虑。

#### 7.5 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。

#### 7.6 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。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

#### 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 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。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 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。

##### 7.10.2 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	179,735.65
2	应收证券清算款	4,082,647.90
3	应收股利	-
4	应收利息	5,722.92
5	应收申购款	4,353,560.99
6	其他应收款	54,290.28
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,675,957.74

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资部分前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.5.2 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	300520	科大国创	9,306.30	0.00	新股流通受限

2	002805	丰元股份	5,631.80	0.00	新股流通受限
---	--------	------	----------	------	--------

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
44,734	8,669.81	256,454.90	0.07%	387,578,842.56	99.93%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	309,392.70	0.0798%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0-10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年4月6日）基金份额总额	487,321,720.94
本报告期期初基金份额总额	260,918,886.49
本报告期基金总申购份额	667,333,559.30
减：本报告期基金总赎回份额	540,417,148.33
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	387,835,297.46

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 基金管理人重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变更。

#### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人无重大人事变更。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的基金管理人、托管人的托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	403,718,436.94	44.11%	367,909.50	44.11%	-
海通证券	1	317,323,489.86	34.67%	289,177.45	34.67%	-
光大证券	1	70,429,105.94	7.70%	64,182.12	7.70%	-
中金公司	1	60,645,959.74	6.63%	55,266.85	6.63%	-
平安证券	1	53,435,192.41	5.84%	48,695.47	5.84%	-
中信证券	2	6,921,584.49	0.76%	6,307.70	0.76%	-
安信证券	1	2,727,779.34	0.30%	2,485.80	0.30%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-

中信万通	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的标准包括以下六个方面：

- (1) 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的

需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

2、选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的程序包括以下四个步骤：

- (1) 券商服务评价；
- (2) 拟定租用对象。由研究部根据以上评价结果拟定备选的券商；
- (3) 上报批准。研究部将拟定租用对象上报分管副总经理批准；
- (4) 签约。在获得批准后，按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

### 3、交易单元变更情况

本基金无交易单元变更。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金面向	上海证券报、	2016-1-20



	养老金客户实施特定申购费率的公告	管理人网站	
2	融通创业板指数增强型证券投资基金第 7 次分红公告	上海证券报、 管理人网站	2016-3-2
3	融通基金管理有限公司关于参加上海陆金所资产管理有限公司费率优惠活动的公告	上海证券报、 管理人网站	2016-3-7
4	融通基金管理有限公司关于参加数米基金网费率优惠活动的公告	上海证券报、 管理人网站	2016-3-9
5	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加平安证券有限责任公司基金申购费率（含定期定额投资）优惠的公告	上海证券报、 管理人网站	2016-3-21
6	关于融通基金管理有限公司旗下开放式基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	上海证券报、 管理人网站	2016-3-31
7	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增包商银行股份有限公司为代销机构及开通定额定额投资和转换业务的公告	上海证券报、 管理人网站	2016-4-8
8	融通基金管理有限公司关于参加上海陆金所资产管理有限公司费率优惠活动的公告	上海证券报、 管理人网站	2016-4-20
9	关于北京晟视天下投资管理有限公司新增销售融通基金管理有限公司旗下部分基金的公告	上海证券报、 管理人网站	2016-4-22
10	融通基金管理有限公司关于对通过本公司直销中心赎回公司旗下部分基金的养老金客户实施特定赎回费率的公告	上海证券报、 管理人网站	2016-5-9
11	关于融通基金管理有限公司旗下开放式基金新增奕丰金融服务（深圳）有限公司为代销机构的公告	上海证券报、 管理人网站	2016-5-13
12	关于融通基金管理有限公司旗下开放式基金在深圳市新兰德证券投资咨询有限公司开通定期定额投资业务及参加基金申购费率优惠的公告	上海证券报、 管理人网站	2016-5-24
13	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增中信银行股份有限公司为代销机构的公告	上海证券报、 管理人网站	2016-5-26
14	关于恒丰银行股份有限公司新增代销融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金并开通定期定额投资、转换业务的公告	上海证券报、 管理人网站	2016-6-6
15	关于融通创业板指数增强型证券投资基金新增中国民生银行股份有限公司为代销机构的公告	上海证券报、 管理人网站	2016-6-15
16	关于融通基金管理有限公司旗下开放式基金新增苏州银行股份有限公司为代销机构并参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、 管理人网站	2016-6-17
17	关于融通基金管理有限公司旗下开放式基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定期定额投资业务并参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、 管理人网站	2016-6-24
18	关于融通基金管理有限公司旗下开放式基金参加交通银行股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	上海证券报、 管理人网站	2016-6-30

## § 11 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》及其更新
- (五) 《融通基金管理有限公司开放式基金业务管理规则》
- (六) 融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- (七) 基金托管人中国工商银行业务资格批件和营业执照

基金管理人、基金托管人处

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> 查阅。