融通通利系列证券投资基金之 融通债券投资基金 2010年年度报告摘要

2010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
送出日期：2011年3月29日

§1 重要提示

1.1 重要提示

融通通利系列证券投资基金由融通债券投资基金、融通深证100指数证券投资基金和融通蓝筹成长证券投资基金共同构成。本年度报告摘要为融通通利系列证券投资基金之子基金融通债券投资基金（以下简称"本基金"）2010年年度报告摘要。

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《融通通利系列证券投资基金基金合同》的规定，于2011年3月25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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中的财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2010年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	融通债券	
基金主代码	161603	
交易代码	161603（前端收费模式）	161653（后端收费模式）
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2003年9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（以下简称"中国工商银行"）	
报告期末基金份额总额	306,026,274.66份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	在强调本金安全的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	以组合优化为基本策略，利用收益曲线模型和债券品种定价模型，在获取较好的稳定收益的基础上，捕捉市场出现的中短期投资机会。
业绩比较基准	中信标普全债指数收益率
风险收益特征	属于相对低风险的基金品种

注：为便于更好的与其他同类基金进行业绩比较，经基金管理人与基金托管人协商一致，本基金的业绩比较基准变更为"中信标普全债指数收益率"，详见基金管理人于2010年2月6日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》上发布的《融通基金管理有限公司关于变更旗下部分基金业绩比较基准的公告》。

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	赵会军
	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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2010年	2009年	2008年
本期已实现收益	11,298,617.60	27,401,516.70	16,206,471.20
本期利润	8,827,403.76	8,516,653.15	46,353,924.18
加权平均基金份额本期利润	0.0231	0.0169	0.0978
本期基金份额净值增长率	2.26%	1.75%	9.22%
3.1.2 期末数据和指标	2010年末	2009年末	2008年末
期末可供分配基金份额利润	0.0798	0.1364	0.1981
期末基金资产净值	330,433,844.58	468,557,569.70	703,114,636.62
期末基金份额净值	1.080	1.136	1.217

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
过去三个月	-0.18%	0.20%	-1.77%	0.10%	1.59%	0.10%
过去六个月	1.79%	0.15%	-0.92%	0.08%	2.71%	0.07%
过去一年	2.26%	0.15%	2.00%	0.07%	0.26%	0.08%
过去三年	13.64%	0.15%	13.79%	0.13%	-0.15%	0.02%
过去五年	41.16%	0.19%	17.94%	0.11%	23.22%	0.08%
自基金合同生效起至今	56.28%	0.20%	27.05%	0.11%	29.23%	0.09%

注：本基金业绩比较基准项目分段计算，其中：2009年12月31日（含此日）之前采用"银行间债券综合指数"，2010年1月1日起使用新基准即"中信标普全债指数收益率"。

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

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2010	0.800	13,911,664.97	18,500,311.09	32,411,976.06	–
2009	1.000	23,561,637.42	24,648,645.23	48,210,282.65	–
2008	0.500	17,119,421.27	10,376,909.21	27,496,330.48	–
合计	2.300	54,592,723.66	53,525,865.53	108,118,589.19	–

§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：新时代证券有限责任公司60%、日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co., Ltd.）40%。

截至2010年12月31日，公司管理的基金共有十只，一只封闭式基金：融通通乾封闭基金，九只开放式基金：融通新蓝筹混合基金、融通通利系列基金、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、融通领先成长股票基金（LOF）、融通内需驱动股票基金和融通深证成份指数基金，其中融通通利系列基金由融通债券基金、融通深证100指数基金和融通蓝筹成长混合基金三只子基金构成，融通领先成长股票基金（LOF）由封闭式基金基金通宝转型而来。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
乔羽夫	本基金的基金经理、融通易支付货币基金的基金经理	2008年3月31日	–	7	经济学硕士，具有证券从业资格。2000年9月至2001年10月，就职于深圳远永盛投资有限责任公司，从事证券交易工作；2004年9月至今，就职于融通基金管理有限公司，先后从事债券交易、债券研究以及债券投资等工作。2005年通过基金从业人员资格考试，2006年获得全国银行间同业拆借中心交易员资格、债券托管结算业务资格。

注：任职日期指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工作的时间为计算标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《融通通利系列证券投资基金基金合同》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 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基金的原则，并制定了相应的制度和流程，在投资决策和交易执行等各个环节保证公平交易原则的严格执行。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 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人旗下没有与融通债券基金投资风格相似的基金。

4.3.3 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

2010年世界主要经济发达国家延续了金融危机以来的低利率、宽货币政策，随之而来的通胀预期和美元贬值推动了国际大宗商品价格的大幅上涨。我国经济在保持了较快的增长水平的同时，在输入性通胀和09年国内宽松货币政策的共同影响下，2010年我国CPI（居民消费价格指数）连续创出新高，国内经济关注的焦点由之前对经济增速放缓的担忧逐步转变为如何有效抑制国内通货膨胀。

为抑制通胀和控制信贷供给，央行先后六次调升法定存款准备金率、两次上调存贷款基准利率。在紧缩的货币政策调控背景下，虽然2010年债券市场"牛陡"收益率曲线"显著上升，但各品种期限在不同时期仍出现过很好的阶段性投资机会。首先，上半年由于企业债审批发行速度放缓，供不应求的信用债收益率大幅下降；其次，3季度市场对经济二次探底的担忧，引发中长期限利率品种的收益率下滑；最后，上调存款准备金率和季度末的资金面紧张引起债券收益率的"超调"也是把握波段投资的有利时机。

2010年，我们基于对宏观经济企稳和通胀趋势向上的判断，在保持组合短久期策略的同时，成功把握了3季度中长期债券利率下滑以及各季度末资金面冲击引致的收益率"超调"的阶段性投资机会。而投资上的许多不足之处也值得我们认真反思，从而总结经验教训：第一，上半年由于风险控制的要求，我们对城投类企业债进行了全部减持，由于没有及时回补其他类企业债券，从而错过了信用债收益率大幅下滑的行情；第二，由于纯债基金受限于不能申购新股和投资股票，本基金保持了一定可转债仓位。但我们对部分可转债流动性差的认识不足，在市场出现大幅调整的情况下，组合很难及时降低可转债持仓。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金份额净值增长率为2.26%，业绩比较基准收益率为2.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2011年，我们认为如何有效抑制通胀仍是2011年货币政策的主要任务。据此判断，在继续紧缩的货币政策环境下，我们在策略上仍以控制久期风险为主。但风险中不代表没有投资机会，我们将密切关注以下几个方面可能出现的变化。

首先，通胀走势得到缓解。由于较高的翘尾因素，2011年上半年CPI走势仍将处于较高水平，在紧缩的货币政策和行政干预的共同作用下，通胀月环比得到有效控制。其次，宏观调控政策可能带来的经济增速下滑。连续的加息和严厉的信贷规模控制将使宏观经济增速放缓，此时可能出现的货币政策转向。最后，利率上升空间有限。目前收益率曲线处于历史较高水平，已经提前反应了市场对高通胀和加息的预期，利率继续大幅上升的空间有限。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

基金管理人坚持一切从保护基金持有人利益出发，继续致力于内控制度与机制的完善，加强合规控制与风险防范，确保基金运作符合法律法规和基金合同的要求。公司监察稽核部门通过合规审核、实时监控及专项检查等方法，对基金运作和公司管理进行独立的监察稽核，及时发现风险隐患，提出整改建议，并督促跟踪业务部门进行整改。

在专项稽核方面，公司监察稽核部门针对不同业务环节的风险特点，制定年度检查计划，并结合对各风险点风险程度的实时判断和评估，按照不同的检查频率，对投资决策、研究支持、交易执行、基金销售、后台运营、信息披露及员工职业操守管理等方面的重点业务环节进行专项检查，检查有关业务执行的合规性和风险控制措施的有效性，检查项目覆盖了相关业务的主要风险点。本报告期内，特别加大了对投资管理人员管控措施、投资决策流程及决策依据、交易执行及后台运作风险等敏感、重点项目的关注，确保基金运作的稳健合规。本基金管理人全年未发生合规及风险事故。

4.7 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、金融工程小组、登记清算部和监察稽核部指定人员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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、本基金管理人于2010年1月21日实施利润分配，以2009年12月31日的可分配收益为基准，每10份基金份额派发现金红利0.80元。

2、本基金管理人于2011年1月12日实施利润分配，以2010年12月31日的可分配收益为基准，每10份基金份额派发现金红利0.30元。

§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

2010年，本基金托管人在对融通债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

2010年，融通债券投资基金的管理人——融通基金管理有限公司在融通债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，融通债券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为32,411,976.06元。

5.3 托管人对本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债券投资基金2010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 审计报告

本基金2010年年度财务会计报告已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告（普华永道中天审字（2011）第21188号），投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表
会计主体：融通债券投资基金
报告截止日：2010年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资产：		
银行存款	30,615,748.22	37,754,204.45
结算备付金	254,326.81	410,001.47
存出保证金	250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	321,389,351.79	425,282,834.66
其中：股票投资	–	–
基金投资	–	–
债券投资	321,389,351.79	405,301,835.31
资产支持证券投资	–	19,980,999.35
衍生金融资产	–	–
买入返售金融资产	–	–
应收证券清算款	–	–
应收利息	1,511,247.63	4,379,000.74
应收股利	–	–
应收申购款	4,166,387.35	37,086,249.00
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	358,187,061.80	505,162,290.32
负债和所有者权益	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
负债：		
短期借款	–	–
交易性金融负债	–	–
衍生金融负债	–	–
卖出回购金融资产款	–	–
应付证券清算款	3,715,479.77	6,875,894.94
应付赎回款	20,885,600.59	26,726,331.96
应付管理人报酬	186,817.75	243,171.76
应付托管费	62,272.61	81,057.26
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	63,322.52	56,601.98
应交税费	2,489,562.27	2,252,189.47
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	350,161.71	369,473.25
负债合计	27,753,217.22	36,604,720.62
所有者权益：		
实收基金	306,026,274.66	412,302,653.39
未分配利润	24,407,569.92	56,254,916.31
所有者权益合计	330,433,844.58	468,557,569.70
负债和所有者权益总计	358,187,061.80	505,162,290.32

注：报告截止日2010年12月31日，基金份额净值1.080元，基金份额总额306,026,274.66份。

7.2 利润表
会计主体：融通债券投资基金
本报告期：2010年1月1日至2010年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
一、收入	12,905,281.12	13,655,275.33
1.利息收入	9,484,934.31	15,232,027.22
其中：存款利息收入	250,303.45	331,825.94
债券利息收入	9,145,667.27	14,341,844.04
资产支持证券利息收入	88,963.59	558,357.24
买入返售金融资产收入	–	–
其他利息收入	–	–
2.投资收益	5,725,769.57	16,986,862.06
其中：股票投资收益	–	–
基金投资收益	–	–
债券投资收益	5,866,338.54	16,695,374.21
资产支持证券投资收益	-140,568.97	–
衍生工具收益	–	291,487.85
股利收益	–	–
3.公允价值变动收益	-2,471,213.84	-18,884,863.55
4.汇兑收益	–	–
5.其他收入	165,791.08	321,249.60
减：二、费用	4,077,877.36	5,138,622.18
1.管理人报酬	2,459,871.59	3,441,048.66
2.托管费	819,957.24	1,147,016.27
3.销售服务费	–	–
4.交易费用	16,750.82	16,343.52
5.利息支出	381,568.92	133,173.06
其中：卖出回购金融资产支出	381,568.92	133,173.06
6.其他费用	399,728.79	401,040.67
三、利润总额	8,827,403.76	8,516,653.15
减：所得税费用	–	–
四、净利润	8,827,403.76	8,516,653.15

7.3 所有者权益（基金净值）变动表
会计主体：融通债券投资基金
本报告期：2010年1月1日至2010年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31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）	412,302,653.39	56,254,916.31	468,557,569.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	8,827,403.76	8,827,403.76
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-106,276,378.73	-8,262,774.09	-114,539,152.82
其中：1.基金申购款	2,298,470,257.24	172,778,556.13	2,471,248,813.37
2.基金赎回款	-2,404,746,635.97	-181,041,330.22	-2,585,787,966.19
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	–	-32,411,976.06	-32,411,976.06
五、期末所有者权益（基金净值）	306,026,274.66	24,407,569.92	330,433,844.58
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31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）	577,940,765.35	125,173,871.27	703,114,636.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	8,516,653.15	8,516,653.15
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-165,638,111.96	-29,225,325.46	-194,863,437.42
其中：1.基金申购款	3,794,360,426.30	506,159,144.86	4,300,519,571.16
2.基金赎回款	-3,959,998,538.26	-535,384,470.32	-4,495,383,008.58
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	–	-48,210,282.65	-48,210,282.65
五、期末所有者权益（基金净值）	412,302,653.39	56,254,916.31	468,557,569.70

注：后附7.4报表附注为本财务报表的组成部分。
本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：
基金管理公司负责人：奚星华　主管会计工作负责人：奚星华　会计机构负责人：刘美丽

7.4 报表附注

7.4.1 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。

7.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错和更正金额。

7.4.3 关联方关系

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	基金托管人、基金代销机构
新时代证券有限责任公司（"新时代证券"）	基金管理人股东、基金代销机构
日兴资产管理有限公司	基金管理人股东

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。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未租用关联方的交易单元。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,459,871.59	3,441,048.66
其中：支付给销售机构的客户维护费	105,262.18	150,801.12

注：支付基金管理人融通基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值0.60%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：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.60%÷当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	819,957.24	1,147,016.27

注：支付基金托管人中国工商银行的基金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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%÷当年天数。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
本期 2010年1月1日至2010年12月31日						
中国工商银行	10,159,516.44	50,414,246.58	–	–	–	–
上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日						
中国工商银行	–	29,451,608.63	–	–	–	–

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度本基金管理人均未投资于本基金。

7.4.4.4.2 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，本基金管理人主要股东及其控制的机构均未投资于本基金。

7.4.4.5 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 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31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	30,615,748.22	245,259.83	37,754,204.45	327,950.27

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。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金本报告期和上年度均未买入管理人、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、本基金本报告期和上年度均未买入管理人、托管人的主要股东（非控股）在承销期承销的股票。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.5 期末（2010年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券持有的流通受限的证券。

7.4.5.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.5.2.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无交易所债券正回购交易中作为抵押的债券。

§8 投资组合报告

8.1 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	–	–
	其中：股票	–	–
2	固定收益投资	321,389,351.79	89.73
	其中：债券	321,389,351.79	89.73
	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	30,870,075.03	8.62
6	其他资产	5,927,634.98	1.65
7	合计	358,187,061.80	100.00

8.2 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	25,269,000.00	7.65
2	央行票据	–	–
3	金融债券	88,794,000.00	26.87
	其中：政策性金融债	88,794,000.00	26.87
4	企业债券	64,139,014.00	19.41
5	企业短期融资券	49,964,000.00	15.12
6	可转债	93,223,337.79	28.21
7	其他	–	–
8	合计	321,389,351.79	97.26

8.3 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	126002	06中化债	343,080	32,575,446.00	9.86
2	110009	双良转债	251,110	32,071,769.20	9.71
3	1080148	10天脊债	300,000	30,084,000.00	9.10
4	100309	10进出09	300,000	29,442,000.00	8.91
5	113001	中行转债	250,430	27,512,239.80	8.33

8.4 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。

8.5 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

本基金不进行主动权证投资，本报告期末未持有因投资可分离转债而获配的权证。

8.6 投资组合报告附注

8.6.1 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。

8.6.2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	250,000.00
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	1,511,247.63
5	应收申购款	4,166,387.35
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	5,927,634.98

8.6.3 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110009	双良转债	32,071,769.20	9.71
2	113001	中行转债	27,512,239.80	8.33
3	125731	美丰转债	20,013,491.61	6.06

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
16,105	19,001.94	2,396,494.64	0.78%	303,629,780.02	99.22%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	777.80	0.0003%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2003年9月30日）基金份额总额	873,462,694.11
本报告期期初基金份额总额	412,302,653.39
本报告期基金总申购份额	2,298,470,257.24
减：本报告期基金总赎回份额	2,404,746,635.97
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	306,026,274.66

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期未召开基金份额持有人大会。

11.2 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

11.2.1基金管理人的重大变动

1、经公司董事会审议通过，同意孟立坤先生辞去公司董事长职务。

具体内容请参阅2010年3月15日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上刊登的公告。

2、经公司董事会审议通过，同意吕秋梅女士辞去公司总经理职务，并决定由公司副总经理秦玮先生代为履行公司总经理职务。

具体内容请参阅2010年3月15日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上刊登的公告。

3、经公司董事会审议并经中国证监会核准，选举田德军先生担任公司董事长职务。

具体内容请参阅2010年5月22日在《证券时报》上刊登的公告。

4、经公司董事会审议并经中国证监会核准，奚星华先生担任公司总经理职务，颜锡廉先生（Allen Yan）担任公司副总经理职务，涂卫东先生担任公司督察长职务。

具体内容请参阅2011年3月26日在《证券时报》上刊登的相关公告。

11.2.2基金托管人的重大变动

经证监会审批，晏秋生任资产托管部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金的投资策略未发生变更。

11.5 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有限公司，该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今，本年度应支付的审计费用为50,000.00元。

11.6 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，基金管理人、托管人及其高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情形。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	债券交易		权证交易		回购交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
上海证券	1	365,472,272.98	80.20%	–	–	130,000,000.00	100.00%	120,000.00	54.55%	–
中信建投	1	90,255,445.84	19.80%	–	–	–	–	100,000.00	45.45%	–

注：1、基金专用交易单元的选择标准和程序：

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）资力雄厚，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、本报告期内基金租用交易单元无变更。

融通基金管理有限公司
二〇一一年三月二十九日

融通通利系列证券投资基金之 融通深证100指数证券投资基金 2010年年度报告摘要

2010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
送出日期：2011年3月29日

§1 重要提示

1.1 重要提示

融通通利系列证券投资基金由融通债券投资基金、融通深证100指数证券投资基金和融通蓝筹成长证券投资基金共同构成。本年度报告摘要为融通通利系列证券投资基金之子基金融通深证100指数证券投资基金（以下简称"本基金"）2010年年度报告摘要。

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《融通通利系列证券投资基金基金合同》规定，于2011年3月25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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中的财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2010年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	融通深证100指数	
基金主代码	161604	
交易代码	161604（前端收费模式）	161654（后端收费模式）
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2003年9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（以下简称"中国工商银行"）	
报告期末基金份额总额	11,923,403,026.51份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	运用指数化投资方式，通过控制股票投资组合与深证100指数的跟踪误差，力求实现对深证100指数的有效跟踪，谋求分享中国经济的持续、稳定增长和中国证券市场的发展，实现基金资产的长期增长，为投资者带来稳定回报。
投资策略	以非债券资产90%以上的资金对深证100指数的成份股进行股票指数化投资。股票指数化投资部分不得低于基金资产的50%，采用复制法跟踪深证100指数，对于因流动性等原因导致无法完全复制深证100指数的情况，将采用剩余组合替换等方法避免跟踪误差扩大。
业绩比较基准	深证100指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%
风险收益特征	风险和预期收益率接近市场平均水平

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	赵会军
	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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2010年	2009年	2008年
本期已实现收益	30,768,418.76	-372,957,836.01	-548,188,473.81
本期利润	-447,957,102.44	7,795,015,526.97	-8,761,175,288.35
加权平均基金份额本期利润	-0.0355	0.7741	-1.1697
本期基金份额净值增长率	-3.66%	103.78%	-60.61%
3.1.2 期末数据和指标	2010年末	2009年末	2008年末
期末可供分配基金份额利润	0.0138	0.0113	-0.2301
期末基金资产净值	15,986,578,174.92	17,258,104,416.79	6,434,252,259.89
期末基金份额净值	1.341	1.392	0.770

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
过去三个月	7.97%	1.88%	8.39%	1.86%	-0.42%	0.02%
过去六个月	32.77%	1.65%	33.47%	1.62%	-0.70%	0.03%
过去一年	-3.66%	1.64%	-2.94%	1.64%	-0.72%	0.00%
过去三年	-22.67%	2.25%	-21.58%	2.27%	-1.09%	-0.02%
过去五年	322.55%	2.13%	365.24%	2.14%	-42.69%	-0.01%
自基金合同生效起至今	292.32%	1.87%	340.25%	1.87%	-47.93%	0.00%

注：本基金业绩比较基准项目分段计算，其中：2005年8月21日之前（含此日）采用"深证100指数×75%+银行间债券综合指数×25%"，2005年8月22日起使用新基准即"深证100指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%"。

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

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2010	–	–	–	–	–
2009	1.800	622,753,930.35	1,354,432,520.69	1,977,186,451.04	–
2008	–	–	–	–	–
合计	1.800	622,753,930.35	1,354,432,520.69	1,977,186,451.04	–

§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：新时代证券有限责任公司60%、日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co., Ltd.）40%。

截至2010年12月31日，公司管理的基金共有十只，一只封闭式基金：融通通乾封闭基金，九只开放式基金：融通新蓝筹混合基金、融通通利系列基金、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、融通领先成长股票基金（LOF）、融通内需驱动股票基金和融通深证成份指数基金，其中融通通利系列基金由融通债券基金、融通深证100指数基金和融通蓝筹成长混合基金三只子基金构成，融通领先成长股票基金（LOF）由封闭式基金基金通宝转型而来。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王建强	本基金的基金经理、融通巨潮100指数基金（LOF）基金经理、融通深证成份指数基金基金经理。	2009年5月15日	–	7	本科学历，具有证券从业资格。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。
郑毅	本基金的基金经理、融通巨潮100指数基金（LOF）基金经理。	2009年5月15日	2010年4月17日	18	研究生学历，具有证券从业资格。1992年至1995年，任中国银行深圳国际信托咨询公司证券部经理；1995年至1997年，任中银国际（香港）公司投资银行部经理；1997年至1999年，任特区证券投资银行总部副总经理；1999年至2008年，就职于鹏华基金管理有限公司，其中2001年9月至2003年4月任基金普润基金经理，后任投资总部副总经理职务；2008年加入融通基金管理有限公司，曾任固定收益小组副组长。

注：任职日期和离任日期均指根据基金管理人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工作的时间为计算标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《融通通利系列证券投资基金基金合同》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 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基金的原则，并制定了相应的制度和流程，在投资决策和交易执行等各个环节保证公平交易原则的严格执行。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 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人旗下没有与本基金投资风格相似的基金。

4.3.3 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

在严格遵守基金合同的前提下实现持有人利益的最大化是本基金管理的核心思想，并将此原则贯彻于基金的运作之中。本基金运用指数化投资方式，竭力通过控制股票投资组合与深证100指数成份股自然权重的偏离，减少基金相对深证100指数的跟踪误差，力求最终实现对深证100指数的有效跟踪。

2010年的A股证券市场出现了非常明显的结构分化特征，深证100指数在2010年下跌3.30%。从组成指数的各行业类指数表现来看：电子元器件、医药、机械设备、有色金属、农林牧渔、食品饮料等行业指数上涨超过20%；而化工、房地产、金融、黑色金属等行业指数下跌超过20%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金份额净值增长率为-3.66%，基金业绩比较基准收益率为-2.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2011年证券市场的表现，我们认为以目前来看，最为重要的两个因素是货币政策和通货膨胀的变化趋势。在通货膨胀的趋势得到明确抑制之前，货币政策趋紧的趋势可能不会有所变化；同时，实体经济对于资金的需求也在持续增加，在货币政策趋紧的情况下，流动性预期的股票也会受到相应的紧缩影响。在2010年出现大幅度上涨的电子信息行业和中小板股票，在2011年相对较为紧张的货币供应局面下，可能出现较大幅度的估值调整。在货币政策趋紧的趋势没有改变之前，我们认为应该谨慎选择和操作。从资产选择来说，我们认为还是需要从实体经济发展的前景出发：处于传统制造业中的有综合竞争优势的企业，我们需要改变2010年的悲观看法；对于新兴行业中的股票，也要改变2010年盲目追捧的态度。长期来看，我们认为证券市场向上的空间还是值得期待，最为重要的因素在于，从2009年起开始的大规模高速铁路网络建设和中西部地区的高速公路网的建设，将在今后的5-10年内给中国的工业产业集群的分布、城市化发展的模式带来大的改变，并带来劳动生产率的大幅度提高，中国在国际上的综合竞争优势将能够得到维持。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

基金管理人坚持一切从保护基金持有人利益出发，继续致力于内控制度与机制的完善，加强合规控制与风险防范，确保基金运作符合法律法规和基金合同的要求。公司监察稽核部门通过合规审核、实时监控及专项检查等方法，对基金运作和公司管理进行独立的监察稽核，及时发现风险隐患，提出整改建议，并督促跟踪业务部门进行整改。

在专项稽核方面，公司监察稽核部门针对不同业务环节的风险特点，制定年度检查计划，并结合对各风险点风险程度的实时判断和评估，按照不同的检查频率，对投资决策、研究支持、交易执行、基金销售、后台运营、信息披露及员工职业操守管理等方面的重点业务环节进行专项检查，检查有关业务执行的合规性和风险控制措施的有效性，检查项目覆盖了相关业务的主要风险点。本报告期内，特别加大了对投资管理人员管控措施、投资决策流程及决策依据、交易执行及后台运作风险等敏感、重点项目的关注，确保基金运作的稳健合规。本基金管理人全年未发生合规及风险事故。

4.7 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、金融工程小组、登记清算部和监察稽核部指定人员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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、本基金于本报告期内未进行利润分配；

2、本基金管理人于2011年1月12日实施利润分配，以2010年12月31日的可分配收益为基准，每10份基金份额派发现金红利0.13元。

§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

2010年，本基金托管人在对融通深证100指数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

2010年，融通深证100指数证券投资基金的管理人——融通基金管理有限公司在融通深证100指数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，融通深证100指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本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深证100指数证券投资基金2010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 审计报告

本基金2010年年度财务会计报告已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告（普华永道中天审字（2011）第21189号），投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表
会计主体：融通深证100指数证券投资基金
报告截止日：2010年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资产：		
银行存款	384,755,788.50	289,865,219.64
结算备付金	–	2,105,541.65
存出保证金	2,086,481.71	3,483,381.35
交易性金融资产	15,575,183,272.91	16,980,283,950.88
其中：股票投资	15,138,721,272.91	16,386,513,950.88
基金投资	–	–
债券投资	436,462,000.00	593,770,000.00
资产支持证券投资	–	–
衍生金融资产	–	–
买入返售金融资产	–	–
应收证券清算款	–	–
应收利息	10,816,929.28	2,008,009.27
应收股利	–	–
应收申购款	60,582,027.91	127,473,920.84
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	16,033,424,500.31	17,405,220,023.63
负债和所有者权益	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
负债：		
短期借款	–	–
交易性金融负债	–	–
衍生金融负债	–	–
卖出回购金融资产款	–	–
应付证券清算款	11,716,908.05	–
应付赎回款	14,506,242.18	125,058,248.00
应付管理人报酬	13,662,680.59	14,356,747.16
应付托管费	2,732,536.14	2,871,349.43
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	1,989,715.21	2,303,607.97
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	2,238,243.22	2,525,654.28
负债合计	46,846,325.39	147,115,606.84
所有者权益：		
实收基金	11,923,403,026.51	12,394,223,828.39
未分配利润	4,063,175,148.41	4,863,880,588.40
所有者权益合计	15,986,578,174.92	17,258,104,416.79
负债和所有者权益总计	16,033,424,500.31	17,405,220,023.63

注：报告截止日2010年12月31日，基金份额净值1.341元，基金份额总额11,923,403,026.51份。

7.2 利润表
会计主体：融通深证100指数证券投资基金
本报告期：2010年1月1日至2010年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
一、收入	-249,202,282.62	7,959,616,974.57
1.利息收入	14,694,954.60	13,192,455.08
其中：存款利息收入	2,618,362.23	3,562,709.20
债券利息收入	12,030,389.09	9,629,745.88
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	46,203.28	–
其他利息收入	–	–
2.投资收益	209,622,964.29	-228,244,652.27
其中：股票投资收益	87,135,395.98	-300,120,383.69
基金投资收益	–	–
债券投资收益	4,614,320.00	-4,788,700.00
资产支持证券投资收益	–	–
衍生工具收益	–	–
股利收益	117,873,248.31	76,664,431.42
3.公允价值变动收益	-478,725,521.20	8,167,973,362.98
4.汇兑收益	–	–
5.其他收入	5,205,319.69	6,695,808.78
减：二、费用	198,754,819.82	164,601,447.60
1.管理人报酬	157,351,259.14	126,389,167.43
2.托管费	31,470,251.77	25,277,833.48
3.销售服务费	–	–
4.交易费用	9,642,617.04	12,653,622.58
5.利息支出	–	–
其中：卖出回购金融资产支出	–	–
6.其他费用	290,691.87	280,824.11
三、利润总额	-447,957,102.44	7,795,015,526.97
减：所得税费用	–	–
四、净利润	-447,957,102.44	7,795,015,526.97

7.3 所有者权益（基金净值）变动表
会计主体：融通深证100指数证券投资基金
本报告期：2010年1月1日至2010年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31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）	12,394,223,828.39	4,863,880,588.40	17,258,104,416.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	-447,957,102.44	-447,957,102.44
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-470,820,801.88	-352,748,337.55	-823,569,139.43
其中：1.基金申购款	7,881,713,902.16	2,073,837,566.34	9,955,551,468.50
2.基金赎回款	-8,352,534,704.04	-2,426,585,903.89	-10,779,120,607.93
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）	11,923,403,026.51	4,063,175,148.41	15,986,578,174.92
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31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）	8,356,863,312.13	-1,922,611,052.24	6,434,252,259.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	7,795,015,526.97	7,795,015,526.97
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	4,037,360,516.26	968,662,564.71	5,006,023,080.97
其中：1.基金申购款	14,973,946,020.19	4,077,413,199.95	19,051,359,220.14
2.基金赎回款	-10,936,585,503.93	-3,108,750,635.24	-14,045,336,139.17
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	–	-1,977,186,451.04	-1,977,186,451.04
五、期末所有者权益（基金净值）	12,394,223,828.39	4,863,880,588.40	17,258,104,416.79

注：后附7.4报表附注为本财务报表的组成部分。
本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：
基金管理公司负责人：奚星华　主管会计工作负责人：奚星华　会计机构负责人：刘美丽

7.4 报表附注

7.4.1 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。

7.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错和更正金额。

7.4.3 关联方关系

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	基金托管人、基金代销机构
新时代证券有限责任公司（"新时代证券"）	基金管理人股东、基金代销机构
日兴资产管理有限公司	基金管理人股东

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。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未租用关联方的交易单元。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	157,351,259.14	126,389,167.43
其中：支付给销售机构的客户维护费	19,744,238.05	15,225,244.19

注：支付基金管理人融通基金管理有限公司的基金管理费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：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.00%／当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	31,470,251.77	25,277,833.48

注：支付基金托管人中国工商银行的基金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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%／当年天数。

7.4.4.3 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均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度本基金管理人均未投资于本基金。

7.4.4.4.2 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，本基金管理人主要股东及其控制的机构均未投资于本基金。

7.4.4.5 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 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31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	384,755,788.50	2,301,193.63	289,865,219.64	3,232,851.86

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。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金本报告期和上年度均未买入管理人、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、本基金本报告期和上年度均未买入管理人、托管人的主要股东（非控股）在承销期承销的股票。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.5 期末（2010年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

7.4.5.2 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
000917	电广传媒	2010-12-27	重大资产重组	24.40	–	–	3,685,406	61,318,047.84	89,923,906.40	–
000652	泰达股份	2010-11-22	公布重大事项	7.78	–	–	10,772,790	129,202,073.34	83,812,306.20	–
000059	辽通化工	2010-12-2	公布重大事项	11.59	–	–	6,815,928	65,039,040.00	78,996,605.52	–

注：本基金截至2010年12月31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。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无交易所债券正回购交易中作为抵押的债券。

§8 投资组合报告

8.1 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	15,138,721,272.91	94.42
	其中：股票	15,138,721,272.91	94.42
2	固定收益投资	436,462,000.00	2.72
	其中：债券	436,462,000.00	2.72
	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	384,755,788.50	2.40
6	其他各项资产	73,485,438.90	0.46
7	合计	16,033,424,500.31	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资部分

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	66,174,411.95	0.41
B	采掘业	1,286,826,039.26	8.05
C	制造业	9,072,581,798.12	56.75
C0	食品、饮料	1,643,104,761.36	10.28
C1	纺织、服装、皮毛	–	–
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	95,938,008.44	0.60
C4	石油、化学、塑胶、塑料	623,985,962.14	3.90
C5	电子	394,248,103.25	2.47
C6	金属、非金属	1,999,034,516.25	12.50
C7	机械、设备、仪表	3,093,524,424.02	19.35
C8	医药、生物制品	1,085,620,143.02	6.79
C99	其他制造业	137,125,879.64	0.86
D	电力、煤气及水的生产和供应业	180,025,343.76	1.13
E	建筑业	–	–
F	交通运输、仓储业	108,251,371.35	0.68
G	信息技术业	560,211,474.40	3.50
H	批发和零售贸易	740,725,506.97	4.63
I	金融、保险业	978,282,070.53	6.12
J	房地产业	1,314,481,814.56	8.22
K	社会服务业	183,024,003.60	1.14
L	传播与文化产业	142,205,414.84	0.89
M	综合类	505,932,023.57	3.16
	合计	15,138,721,272.91	94.70

8.2.2 积极投资部分

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

8.3 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

8.3.1 指数投资部分前十名

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	000002	万 科A	93,309,734	767,006,013.48	4.80
2	000858	五 粮 液	19,149,703	663,154,214.89	4.15
3	002024	苏宁电器	44,208,575	579,132,332.50	3.62
4	000001	深发展A	27,695,290	437,308,629.10	2.74
5	000983	西山煤电	16,208,536	432,605,825.84	2.71
6	000063	中兴通讯	15,437,934	421,455,598.20	2.64
7	000338	潍柴动力	7,940,580	415,848,174.60	2.60
8	000651	格力电器	21,684,896	393,147,164.48	2.46
9	000157	中联重科	24,052,305	340,099,592.70	2.13
10	000527	美的电器	19,295,646	335,744,240.40	2.10

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人融通基金管理有限公司网站（http://www.rtfund.com）的年度报告正文。

8.3.2 积极投资部分前五名

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	000709	河北钢铁	152,457,626.19	0.88
2	002106	莱宝高科	133,874,644.53	0.78
3	000338	潍柴动力	114,490,352.02	0.66
4	000002	万 科A	100,200,369.89	0.58
5	000829	天音控股	90,676,040.11	0.53
6	000559	万向钱潮	68,770,073.08	0.40
7	000762	西藏矿业	68,591,174.78	0.40
8	000858	五 粮 液	67,188,984.60	0.39
9	000063	中兴通讯	64,283,637.01	0.37
10	002056	横店东磁	64,039,510.24	0.37
11	002024	苏宁电器	60,444,750.09	0.35
12	000983	西山煤电	59,705,877.57	0.35
13	000066	长城电脑	59,038,488.74	0.34
14	000012	南 玻A	55,727,439.18	0.32
15	002122	天马股份	52,149,502.79	0.30
16	000001	深发展A	51,790,003.72	0.30
17	000786	北新建材	48,382,582.16	0.28
18	002069	獐 子 岛	48,076,376.96	0.28
19	000522	白云山A	46,282,443.61	0.27
20	000651	格力电器	41,291,954.06	0.24

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。

8.4.2 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	000002	万 科A	168,354,933.37	0.98
2	000858	五 粮 液	131,261,562.65	0.76
3	000001	深发展A	126,178,625.33	0.73
4	002024	苏宁电器	106,118,894.18	0.61
5	000983	西山煤电	100,728,749.66	0.58
6	000807	云铝股份	85,429,034.57	0.50
7	000063	中兴通讯	79,040,929.82	0.46
8	000651	格力电器	75,070,450.20	0.43
9	000581	威孚高科	65,145,580.72	0.38
10	000527	美的电器	64,097,773.26	0.37
11	000157	中联重科	58,725,836.51	0.34
12	000717	韶钢松山	57,971,500.67	0.34
13	000338	潍柴动力	57,496,063.16	0.33
14	000822	山东海化	55,396,420.80	0.32
15	000046	泛海建设	54,213,594.26	0.31
16	000623	吉林敖东	49,955,647.36	0.29
17	000959	首钢股份	49,376,232.09	0.29
18	000932	华菱钢铁	48,973,514.59	0.28
19	000511	银基发展	47,972,018.90	0.28
20	000089	深圳机场	47,509,975.51	0.28

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。

8.4.3 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	2,642,785,618.47
卖出股票收入（成交）总额	3,502,353,071.22

注：表中"买入股票成本（成交）总额"及"卖出股票收入（成交）总额"均指成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	–	–
2	央行票据	436,462,000.00	2.73
3	金融债券	–	–
	其中：政策性金融债	–	–
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	可转债	–	–
7	其他	–	–
8	合计	436,462,000.00	2.73

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1001021	10央行票据21	2,000,000	195,620,000.00	1.22
2	0801053	08央行票据53	1,400,000	140,602,000.00	0.88
3	0801029	08央行票据29	1,000,000	100,240,000.00	0.63

8.7 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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 报告期内本基金投资的前十名股票中，无投资于基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.9.3 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	2,086,481.71
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	10,816,929.28
5	应收申购款	60,582,027.91
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	73,485,438.90

8.9.4 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。

8.9.5期末股票中存在流通受限情况的说明

8.9.5.1 指数投资前十名

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。

8.9.5.2 积极投资前五名

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
999,807	11,925.70	125,050,213.59	1.05%	11,798,352,812.92	98.95%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	2,477,781.41	0.0208%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2003年9月30日）基金份额总额	477,689,377.16
本报告期期初基金份额总额	12,394,223,828.39
本报告期基金总申购份额	7,881,713,902.16
减：本报告期基金总赎回份额	8,352,534,704.04
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	11,923,403,026.51

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期未召开基金份额持有人大会。

11.2 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

11.2.1基金管理人的重大变动

1、经公司董事会审议通过，同意孟立坤先生辞去公司董事长职务。

具体内容请参阅2010年3月15日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上刊登的公告。

2、经公司董事会审议通过，同意吕秋梅女士辞去公司总经理职务，并决定由公司副总经理秦玮先生代为履行公司总经理职务。

具体内容请参阅2010年3月15日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上刊登的公告。

3、自2010年4月17日起，郑毅先生不再担任本基金的基金经理，王建强先生继续担任本基金的基金经理。

具体内容请参阅2010年4月17日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上刊登的相关公告。

4、经公司董事会审议并经中国证监会核准，选举田德军先生担任公司董事长职务。

具体内容请参阅2010年5月22日在《证券时报》上刊登的公告。

5、经公司董事会审议并经中国证监会核准，奚星华先生担任公司总经理职务，颜锡廉先生（Allen Yan）担任公司副总经理职务，涂卫东先生担任公司督察长职务。

具体内容请参阅2011年3月26日在《证券时报》上刊登的相关公告。

11.2.2基金托管人的重大变动

经证监会审批，晏秋生任资产托管部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金的投资策略未发生变更。

11.5 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有限公司，该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今，本年度应支付的审计费用为170,000.00元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
安信证券	1	2,595,284,471.08	42.29%	2,108,683.65	42.29%	–
长城证券	1	1,892,257,406.27	30.84%	1,537,472.70	30.84%	–
长江证券	1	1,219,226,317.28	19.87%	990,630.77	19.87%	–
海通证券	1	246,252,001.37	4.01%	200,080.67	4.01%	–
中金公司	1	109,521,329.95	1.78%	88,986.72	1.78%	–
中信证券	1	74,137,922.92	1.21%	60,237.75	1.21%	–
中信万通	1	–	–	–	–	–
华泰联合证券	1	–	–	–	–	–
平安证券	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）资力雄厚，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、本报告期内基金租用交易单元无变更。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券	11,463,498.80	57.97%	–	–	–	–
长城证券	8,312,265.82	42.03%	–	–	–	–
长江证券	–	–	–	–	–	–
海通证券	–	–	–	–	–	–
中金公司	–	–	–	–	–	–
中信证券	–	–	–	–	–	–
中信万通	–	–	–	–	–	–
华泰联合证券	–	–	–	–	–	–
平安证券	–	–	–	–	–	–

融通基金管理有限公司
二〇一一年三月二十九日