

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:2012年3月26日

§1 重要提示
融通通利系列证券投资基金由融通证券投资基金、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基金融通深证100指数证券投资基金(以下简称“本基金”)2011年年度报告摘要。

基金管理人、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。

本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合同》约定,于2012年3月20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,保证报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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预示其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前应先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,应阅读年度报告全文。
基金管理人、会计师事务所、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。
本财务报告自2011年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

基金简称	融通深证100指数
基金主代码	161604
交易代码	161604 (前收赎费模式) 161654 (后收赎费模式)
基金运作方式	契约开放式
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(以下简称“中国工商银行”)
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	13,719,041,075.95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,谋求分享中国宏观经济持续、稳定增长和中国证券市场的投资,实现基金资产的长期增长,为投资者带来长期回报。

投资策略:以非债券资产90%以上的资产对深证100指数的成份股进行指数化投资,股票类资产投资部分不得低于基金资产的50%。采用复利跟踪深证100指数,对于因流动性等因素导致无法完全跟踪深证100指数的情况,将采用替代组合等方式避免跟踪误差扩大。

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:风险等级预期收益接近市场平均水平

2.3 基金管理人及基金托管人

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
法定代表人	涂卫东	姜宝军
信息披露负责人	邵卫华	魏斌
联系电话	0755-26948666	010-66100799
电子邮箱	service@mail.rtfund.com	custody@icc.com.cn
客户服务电话	400-883-8088, 0755-26948088	95588
传真	0755-26935005	010-66100798

2.4 信息披露方式

本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

3.1.1 期间数据和指标	2011年	2010年	2009年
本期已实现收益	-136,206,089.03	30,768,418.76	-372,957,836.01
本期利润	-5,218,992,403.51	-447,987,102.44	7,795,015,526.97
加权平均基金份额本期利润	-0.4041	-0.0355	0.7741
本基金份额净值增长率	-29.66%	-3.66%	103.78%
3.1.2 期末数据和指标	2011年末	2010年末	2009年末
期末可供基金份额净值	-0.0665	0.0138	0.0113
期末基金资产净值	12,807,082,759.36	15,986,578,174.92	17,258,104,416.79
期末基金份额净值	0.934	1.141	1.392

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,则期末未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)。

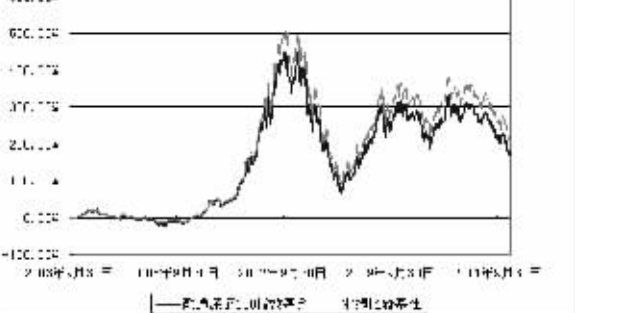
3.2 基金净值表现

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

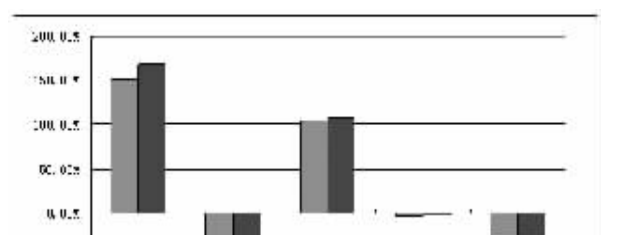
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-13.04%	1.46%	-12.99%	1.46%	-0.05%	0.00%
过去六个月	-26.22%	1.37%	-26.00%	1.37%	-0.22%	0.00%
过去一年	-29.66%	1.34%	-28.92%	1.34%	-0.74%	0.00%
过去三年	38.09%	1.70%	43.21%	1.71%	-5.12%	-0.01%
过去五年	36.81%	2.12%	49.68%	2.13%	-12.87%	-0.02%
自基金合同生效起至今	173.96%	1.82%	212.91%	1.82%	-36.95%	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指数收益率75%+银行间债券综合收益率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 过去三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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

年度	每100份基金份额分红次数	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
2011	0.130	45,034,338.58	109,891,312.26	154,925,650.84	-
2010	-	-	-	-	-
2009	1.800	622,753,930.33	1,354,432,320.69	1,977,186,451.04	-
合计	1.930	667,788,268.91	1,464,323,632.95	2,132,112,101.88	-

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经营情况

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金字[2001]8号文批准,于2001年5月22日成立,公司注册资本12000万元人民币。本公司的股东及出资比例分别为:新时代证券股份有限公司76.06%、日兴资产管理有限公司 Nikko Asset Management Co., Ltd. 30.9%。

截至2011年12月31日,公司管理的基金共有十二只,一只封闭式基金,即融通封闭基金,十一只开放式基金,即融通蓝筹成长证券投资基金、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、融通蓝筹成长基金、融通蓝筹成长基金、融通蓝筹成长基金、融通蓝筹成长基金、融通蓝筹成长基金、融通蓝筹成长基金、融通蓝筹成长基金、融通蓝筹成长基金。

4.1.2 基金基金经理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
王 健	基金经理	2009年5月15日至至今	8	本科学历,具有证券从业资格。2001年5月至2004年任职于上海东方证券资产管理有限公司,2004年5月至2007年任职于融通基金管理有限公司,历任基金经理助理、基金经理、基金管理部副经理。
陶 武彬	基金经理	2011年6月11日至2011年12月8日	15	硕士学位,具有证券从业资格。曾先后在中国化工建设深圳公司、深圳市深投投资有限公司、香港中汇一证券投资咨询有限公司、投资和投资银行等行业工作;2001年1月至今,任职于融通基金管理有限公司,历任行业研究员、基金经理、投资经理及部门副总经理。

注:任职日期和离任日期指根据基金管理人对外披露的任免日期填写;证券从业年限指从事证券业务相关工作工作的时间为计算标准。

4.2 管理人报告期内本基金遵守法律法规的情况

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、法规及基金合同的约定。

4.3 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严格执行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了公平交易制度和交易执行。

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投资组合。

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,我们坚持以利益最大化为原则,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,通过控制跟踪误差实现与深证100指数或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。

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

2011 年度 报告摘要

2011年12月31日

2011年的A股市场出现了大幅度的下跌,深证100指数在2011年下跌30.30%。从组成该指数的各行业类指数表现来看,所有行业都出现较大幅度的下跌,其中食品饮料、金融行业指数下跌少于20%,而电子、有色金属等行业指数下跌超过20%。

4.2 报告期内本基金的投资表现
报告期内本基金份额净值增长率为-29.66%,基金业绩比较基准收益率为-28.92%。

4.3 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望2012年,我们不敢对于2012年市场对于宏观调控和货币政策方面有过几次短暂的反弹,并阶段性性的反弹。2012年,实体经济处于后金融危机时期,全世界各大经济体都在寻求新的均衡下的复苏,A股市场也处于反弹前的长期增长趋势的初期。我们认为2012年如能出现趋势性的变化,一方面需要实体经济增长较为稳健的前提下找到增长的下限,另一方面需要政府在经济增长的瓶颈领域释放较大的政策红利。在前期阶段,我们认为实体经济尚处于寻找潜在增长下限的过程中,另一方面在政策放松的过渡期,我们可能很难看到政策红利释放的具体举措。在当前位置,我们认为对于2012年指数增长幅度保持乐观期待又不过乐观的判断,我们并不认为宏观经济增长的长期趋势,从城市化的深化和经济发展面临的许多约束来看,政策红利释放将是长期的空间还很大。

4.4 管理人对于报告期内本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《融通通利系列证券投资基金估值业务操作规程和程序》进行,公司成立由财务部、金融工程小组、登记清算部和监察稽核部指定专人负责共同组成的估值委员会,通过参考行业协会估值意见、参与独立第三方机构估值数据等多种方式方法的有效结合,确保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。

估值委员会定期对环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生重大影响证券价格的事件以及估值政策和程序进行了评价,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。其中研究员负责定期对环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生重大影响证券价格的事件以及估值政策和程序进行了评价,金融工程小组负责估值方法的研究,价格的核实及复核,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允价值、基金公允价值方法的法规等进行了整理汇总,供估值委员会参考。监察稽核部负责基金估值业务的开展,事及事后数据的审核工作。基金经理不参与估值定价,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服务机构签约。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
1.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日的可供分配收益为基准,每100基金份额派发发现金红利0.13元。
2.截至2011年12月31日,本基金每基金份额可供分配利润为-0.0665元,依据基金合同的约定,不进行利润分配。

§5 托管人报告

2011年,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负的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵守法律法规、净值计算、利润分配等情况的说明
2011年,融通深证100指数证券投资基金的托管人——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、基金费用开支等方面,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约定进行。本报告期内,融通深证100指数证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154,925,650.84元。

3.2 托管人对本年度报告中财务信息等内容进行了核实,以上内容真实、准确和完整。
本托管人对融通基金管理有限公司编制的融通深证100指数证券投资基金2011年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。

本基金的2011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[2012]第20587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:2011年12月31日

资产	本报告期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
货币资金	107,502,431.38	384,755,788.50
结算备付金	4,223,827.85	-
存出保证金	3,351,902.51	2,086,481.71
交易性金融资产	12,767,891,323.07	15,575,183,272.91
其中:股票投资	12,143,273,323.07	15,138,721,272.91
基金投资	-	-
债券投资	624,618,000.00	436,462,000.00
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	7,200,101.19	10,816,929.28
应收股利	-	-
应收申购款	19,316,115.52	60,582,027.91
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	12,909,665,701.52	16,033,424,500.31

负债和所有者权益

负债合计	本报告期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	77,273,180.47	11,716,908.05
应付赎回费	7,270,203.23	14,506,242.18
应付管理人报酬	11,355,852.28	13,662,680.59
应付托管费	2,271,170.45	2,732,536.14
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,749,371.17	1,989,715.21
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付股利	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	2,203,164.56	2,238,243.22
负债合计	102,582,942.16	46,846,325.39

所有者权益

所有者权益合计	本报告期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
实收基金	13,719,041,075.95	11,923,403,026.51
未分配利润	-91,955,316.59	4,063,175,481.41
所有者权益合计	12,807,082,759.36	15,986,578,174.92
负债和所有者权益总计	12,909,665,701.52	16,033,424,500.31

注:报告截止日2011年12月31日,基金份额净值0.934元,基金份额总额13,719,041,075.95份。

7.2 利润表

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年同期可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
一、收入	-5,018,449,762.72	-249,202,282.62
1.利息收入	10,260,574.77	14,694,954.60
其中:存款利息收入	2,723,526.39	2,618,362.23
债券利息收入	17,523,048.38	12,030,389.09
资产支持证券投资收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	46,203.28
其他利息收入	-	-
2.投资收益	41,846,295.23	209,622,964.29
其中:股票投资收益	-86,127,119.87	87,135,395.98
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-3,825,800.00	4,614,320.00
资产支持证券投资收入	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收入	131,799,215.10	117,873,248.31
3.公允价值变动收益	-5,082,786,314.48	-478,725,521.20
4.汇兑收益	-	-
其他收入	2,243,681.76	5,205,319.69
二、费用	200,542,640.79	198,754,819.82
1.管理人报酬	156,164,784.92	131,471,259.14
2.托管费	31,232,956.94	31,470,251.77
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	12,852,307.38	9,642,617.04
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	292,591.55	290,691.87
三、利润总额	-5,218,992,403.51	-447,987,102.44
四、净利润	-5,218,992,403.51	-447,987,102.44

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年同期可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
一、期初所有者权益(基金净值)	11,923,403,026.51	4,063,175,481.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-5,218,992,403.51	-447,987,102.44
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(本期申购、赎回及转换等款项)	1,795,638,049.44	398,784,589.35
其中:基金申购款	5,948,511,642.73	1,394,569,740.63
基金赎回款	-4,152,873,593.29	-995,785,151.28
四、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	-154,925,650.84	-154,925,650.84
五、期末所有者权益(基金净值)	13,719,041,075.95	11,923,403,026.51

注: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
报告截止日:2011年1月1日至2011年12月31日

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年同期可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
一、期初所有者权益(基金净值)	11,923,403,026.51	4,063,175,481.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-5,218,992,403.51	-447,987,102.44
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(本期申购、赎回及转换等款项)	1,795,638,049.44	398,784,589.35
其中:基金申购款	5,948,511,642.73	1,394,569,740.63
基金赎回款	-4,152,873,593.29	-995,785,151.28
四、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	-154,925,650.84	-154,925,650.84
五、期末所有者权益(基金净值)	13,719,041,075.95	11,923,403,026.51

注: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
报告截止日:2011年1月1日至2011年12月31日

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年同期可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
一、期初所有者权益(基金净值)	11,923,403,0	