

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

2012 第四季度 报告

2012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
报告送出日期:2013年1月22日

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组成,本报告为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(以下简称“本基金”)2012年第四季度报告。

Table with 2 columns: 基金简称 (融通深证100指数), 基金代码 (161604), 交易代码 (161604), 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), 报告期末基金份额总额 (15,247,940,461.07份)

投资目标
运用指数化投资方式,通过控制投资组合与深证100指数的跟踪误差,力争实现对深证100指数的有效跟踪,或在中长期投资期限内,稳定增长和中国证券市场的发展,实现基金资产的长期增值,为投资者带来稳定回报。

投资策略
以证券资产70%以上的资产对深证100指数的成份股进行投资,投资组合中投资于深证100指数的成份股市值不低于基金资产净值的50%,采用复制法跟踪深证100指数,对因流动性等因素导致无法完全复制深证100指数的情况,将采用市值组合替代等方法跟踪深证100指数。

业绩比较基准
深证100指数收益率*95%+银行同业存款利率*5%

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期 (2012年10月1日 - 2012年12月31日), 1.本期已实现收益 (-816,481,091.34), 2.本期利润 (718,152,113.12), 3.加权平均基金份额本期利润 (0.0469), 4.期末基金资产净值 (14,547,973,622.30), 5.期末基金份额净值 (0.954)

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

注:2.本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购及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。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 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

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
本基金业绩比较基准采用日分段计算,其中,2005年8月21日之前(含当日)采用“深证100指数*95%+银行同业存款利率*5%”,2005年8月22日起使用新基准即“深证100指数*95%+银行同业存款利率*5%”。

4.1 基金经理简介
姓名 王 斌, 职务 本基金的基金经理兼融通深证100指数证券投资基金(LOF)基金经理, 聘任日期 2009年5月15日, 聘任年限 9

4.2 报告期内基金经理对外披露的任职日期情况,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。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
4.3.2 异常交易行为的专项说明

4.4 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理念,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,竭力通过控制投资组合权重与深证100指数成份股自然权重的偏差,减小基金相对深证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。

4.5 报告期内基金的投资表现
本报告期基金份额净值增长率为5.18%,同期业绩比较基准收益率为4.99%。

5.1 报告期末基金资产组合情况
5.1.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 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(%)

5.1.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
5.1.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

5.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名基金投资明细

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

5.6 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

5.7 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权证投资明细

5.8 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.9 报告期末持有的资产支持证券明细

5.10 报告期末持有的其他资产明细

5.11 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资产支持证券投资明细

5.12 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

5.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

5.15 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

5.16 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权证投资明细

5.17 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资产支持证券投资明细

5.18 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

5.19 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权证投资明细

5.20 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资产支持证券投资明细

5.21 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

5.22 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权证投资明细

5.23 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资产支持证券投资明细

5.24 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

5.25 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权证投资明细

5.26 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资产支持证券投资明细

5.27 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

5.28 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权证投资明细

5.29 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资产支持证券投资明细

5.30 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

5.31 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权证投资明细

5.32 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资产支持证券投资明细

5.33 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

5.34 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权证投资明细

5.35 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资产支持证券投资明细

5.36 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

5.37 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权证投资明细

5.38 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资产支持证券投资明细

5.39 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

5.40 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权证投资明细

5.41 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资产支持证券投资明细

5.42 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

5.43 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权证投资明细

5.44 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资产支持证券投资明细

5.45 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

5.46 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权证投资明细

5.47 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资产支持证券投资明细

5.48 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

5.49 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权证投资明细

5.50 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资产支持证券投资明细

5.51 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

5.52 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权证投资明细

5.53 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资产支持证券投资明细

5.54 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

5.55 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权证投资明细

5.56 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资产支持证券投资明细

5.57 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

5.58 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权证投资明细

5.59 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资产支持证券投资明细

5.60 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

5.61 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权证投资明细

5.62 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资产支持证券投资明细

5.63 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

5.64 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权证投资明细

5.65 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资产支持证券投资明细

5.66 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

5.67 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权证投资明细

5.68 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资产支持证券投资明细

5.69 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

5.70 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权证投资明细

5.71 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资产支持证券投资明细

5.72 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

5.73 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权证投资明细

5.74 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资产支持证券投资明细

5.75 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

5.76 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权证投资明细

5.77 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资产支持证券投资明细

5.78 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

5.79 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权证投资明细

5.80 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资产支持证券投资明细

5.81 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

5.82 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权证投资明细

5.83 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资产支持证券投资明细

5.84 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

5.85 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权证投资明细

5.86 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资产支持证券投资明细

5.87 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

5.88 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权证投资明细

5.89 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资产支持证券投资明细

5.90 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

5.91 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权证投资明细

5.92 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资产支持证券投资明细

5.93 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

5.94 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权证投资明细

5.95 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资产支持证券投资明细

5.96 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

5.97 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权证投资明细

5.98 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资产支持证券投资明细

5.99 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

5.100 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权证投资明细

5.101 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资产支持证券投资明细

5.102 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

5.103 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权证投资明细

5.104 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资产支持证券投资明细

5.105 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

5.106 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权证投资明细

5.107 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资产支持证券投资明细

5.108 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

5.109 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权证投资明细

5.110 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资产支持证券投资明细

5.111 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

5.112 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权证投资明细

5.113 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资产支持证券投资明细

5.114 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

5.115 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权证投资明细

5.116 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资产支持证券投资明细

5.117 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

5.118 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权证投资明细

5.119 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资产支持证券投资明细

5.120 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

5.121 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权证投资明细

5.122 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资产支持证券投资明细

5.123 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

5.124 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权证投资明细

5.125 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资产支持证券投资明细

5.126 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

5.127 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权证投资明细

5.128 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资产支持证券投资明细

5.129 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

5.130 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权证投资明细

5.131 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资产支持证券投资明细

5.132 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

5.133 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权证投资明细

5.134 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资产支持证券投资明细

5.135 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

5.136 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权证投资明细

5.137 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资产支持证券投资明细

5.138 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

5.139 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权证投资明细

5.140 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资产支持证券投资明细

5.141 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

5.142 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权证投资明细

5.143 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资产支持证券投资明细

5.144 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

5.145 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权证投资明细

5.146 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资产支持证券投资明细

5.147 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

5.148 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权证投资明细

5.149 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资产支持证券投资明细

5.150 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

5.151 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权证投资明细

5.152 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资产支持证券投资明细

5.153 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

5.154 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权证投资明细

5.155 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资产支持证券投资明细

5.156 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

5.157 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权证投资明细

5.158 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资产支持证券投资明细

5.159 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

5.160 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权证投资明细

5.161 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资产支持证券投资明细

5.162 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

5.163 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权证投资明细

5.164 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资产支持证券投资明细

5.165 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

5.166 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权证投资明细

5.167 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资产支持证券投资明细

5.168 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

5.169 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权证投资明细

5.170 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资产支持证券投资明细

5.171 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

5.172 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权证投资明细

5.173 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资产支持证券投资明细

5.174 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

5.175 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权证投资明细

5.176 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资产支持证券投资明细

5.177 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

5.178 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权证投资明细

5.179 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资产支持证券投资明细

5.180 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

5.181 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权证投资明细

5.182 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资产支持证券投资明细

5.183 报告期末按公允价值占