

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:2013年3月29日

5.1 重要提示

融通通利系列证券投资基金管理人,融通深证100指数证券投资基金和融通蓝筹证券投资基金共同组成。本年度报告适用于融通通利系列证券投资基金份额之基金金融深证100指数证券投资基金(以下简称“本基金”)2012年度报告摘要。基金管理人的董事、监事、高级管理人员不存在虚假记载、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责任及连带的法律责任。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。

基金管理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份额之基金金融深证100指数证券投资基金合同》规定,于2012年3月26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。

基金经理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。

本公司所作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2012年1月1日起至12月31日止。

5.2 基金简介

基金名称	融通深证100指数
基金代码	161604
场内简称	融通100
上市交易代码	161604
基金管理人	融通基金管理有限公司
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
报告期末基金总资产	15,247,940,461.07元
基金合同存续期	不定期

5.3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

金额单位:人民币元

5.3.1 期间数据和指标

2012年 2011年 2010年

本期实现收益 -1,095,504,729.46 -136,206,089.03 30,768,418.76

本期利润 250,690,807.23 -5,218,992,403.51 -447,957,102.44

加权平均基金份额本期利润 0.0170 -0.4041 -0.0355

基金份额净值增长率为 2.14% -29.66% -3.66%

5.3.2 期末数据和指标

2012年末 2011年末 2010年末

期末基金份额净值 -0.0894 -0.0665 0.0138

期末基金份额净值 -0.0894 -0.0665 0.0138

期末基金份额净值 -0.0894 -0.0665 0.0138

注:上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率将低于所列数字。

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总额=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为期末利润分配时点的可供分配利润,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的金额,如期末可供分配利润的实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除非实现部分)。

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 5.18% 1.29% 4.99% 1.28% 0.19% 0.01%

过去六个月 -3.64% 1.34% -3.22% 1.34% -0.42% 0.00%

过去一年 2.14% 1.38% 3.32% 1.38% -1.18% 0.00%

过去两年 -30.78% 1.46% -28.72% 1.46% -2.06% 0.00%

过去三年 -44.45% 1.95% -42.41% 1.95% -2.04% 0.00%

自基金合同生效日起至今 181.86% 1.77% 223.29% 1.78% -41.43% -0.01%

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×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

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

3.2.3 过去五年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

3.2.4 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

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。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2012年12月31日,公司管理的基金共有十六只,一只封闭式基金,即融通通乾封闭基金;十五只开放式基金,即融通蓝筹混合基金、融通货币基金、融通深证100指数基金、融通货币市场基金、融通深证100指数基金、融通行业景气混合基金、融通巨潮100指数基金(LOF)、融通行业景气股票基金、融通领先成长股票基金(LOF)、融通行业景气股票基金、融通行业景气股票基金、融通深证四季盈利债券基金、融通创业板指数基金、融通医疗保健行业股票基金和融通岁定期开放债券基金等。其中,融通债券基金、融通深证100指数基金和融通货币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 基金经理简介

姓名 职务 任职本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

王星海 基金总经理、融通100指数基金经理、融通深证100指数基金经理、融通货币基金经理、融通行业景气基金经理、融通巨潮100指数基金经理 2009年5月15日 - 9 本科学历,具有证券从业资格,2000年至2004年就职于上海市工行信息技术股份有限公司,2004年至2006年就职于融通基金管理有限公司,2006年加入融通基金管理有限公司。

注:任职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 管理人对报告期内基金运作合规守信情况的说明

本公司报告期内严格遵守《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份额之基金金融深证100指数证券投资基金合同》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 公平交易制度和控制方法

为了保证旗下所有的不同投资组合得到公平对待,本公司管理人制定了《融通基金管理有限公司公平交易制度》,公平交易制度所规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场价格、二级市场价格等所有投资管理活动,并涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理相关的各个环节。

本公司管理人通过建立科学的投资决策体系,加强交易执行环节的内部控制,并通过工作制度、流程和操作手段来保证公平交易原则的实现。同时,本公司管理人通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 平公平交易制度的执行情况

本公司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、业绩评估等各个方面严格执行公平交易原则的严格执行。

本公司管理人对报告期内不同时间窗下(日内、3日、5日、3个月内)公司管理的不同投资组合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内。

报告期内,本公司管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

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基金管理的核心思

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年度报告摘要

2012年12月31日

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 错误更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错更正内容和更正金额。

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 行业 中国工商银行业

新时达企业 有限公司 (“新时代证券”) 基金托管人,基金代销机构

融通基金管理有限公司 基金管理人

注:下述关联交易仅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

注:“买入金额”是指买入股票成交金额,即成交量乘以成交数量,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	000663	中兴通讯	129,667,011.14	1.01
2	000858	五粮液	125,905,690.34	0.98
3	000401	冀东水泥	96,822,848.44	0.76
4	000100	TCL集团	80,845,126.99	0.63
5	002034	苏宁电器	78,179,108.27	0.61
6	000001	平安银行	76,518,057.12	0.60
7	000024	招商地产	75,411,491.22	0.59
8	000002	万科A	67,840,911.42	0.53
9	000776	广发证券	71,352,314.72	0.56
10	000898	鞍钢股份	70,251,241.27	0.55
11	000522	白云山A	67,840,911.42	0.53
12	000651	格力电器	62,462,954.87	0.49
13	000541	佛山照明	61,784,285.46	0.48
14	000562	宏达证券	60,169,415.04	0.47
15	000400	吉电股份	59,423,658.96	0.46
16	000039	中集集团	59,309,779.14	0.46
17	000568	泸州老窖	58,303,310.20	0.46
18	000157	中联重科	58,123,777.39	0.45
19	000680	山推股份	57,655,611.28	0.45
20	002233	辉丰集团	54,738,802.46	0.43

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

8.4.3 买入股票的成本(成交)总额

金额单位:人民币元

</div