融通深证成份指数证券投资基金

2012 年度 报告摘要

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
送出日期:2013年3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深证成份指数证券投资基金(以下简称"本基金")基金合同规定,于2013年3月21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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	融通深证成份指数
基金主代码	161612
前端交易代码	161612
后端交易代码	161662
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年11月15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	1,189,108,813.41份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取完全复制方法进行指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%以内,以实现对深证成份指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金,原则上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,力争实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差控制在0.35%以内、年化跟踪误差控制在4%的投资目标。
业绩比较基准	深证成份指数收益率×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	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、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	2012年	2011年	2010年11月15日(基金合同生效日)-2010年12月31日
本期已实现收益	-74,960,147.76	5,106,754.64	-3,710,444.21
本期利润	15,183,372.50	-277,393,804.09	16,903,550.23
加权平均基金份额本期利润	0.0128	-0.2280	0.0092
本期基金份额净值增长率	3.15%	-27.55%	0.90%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2464	-0.2686	-0.0020
期末基金资产净值	896,127,097.24	810,416,058.77	1,800,976,758.49
期末基金份额净值	0.754	0.731	1.009

注:(1)本基金合同生效日为2010年11月15日;

(2)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;

(3)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;

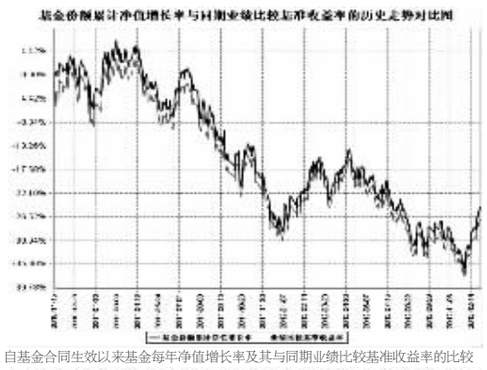
(4)期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配利润:如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

3.2 基金净值表现

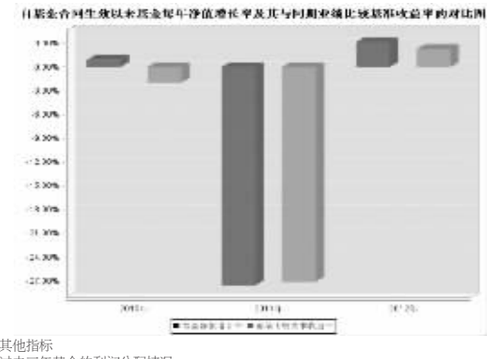
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	5.31%	1.30%	4.81%	1.26%	0.50%	0.04%
过去六个月	-2.96%	1.33%	-3.78%	1.32%	0.82%	0.01%
过去一年	3.15%	1.36%	2.25%	1.36%	0.90%	0.00%
自基金合同生效起至今	-24.60%	1.31%	-26.94%	1.35%	2.34%	-0.04%

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 自基金合同生效以来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 其他指标

3.4 过去三年基金的利润分配情况

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
2012					
2011	-	-	-	-	-
2010	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注:本基金合同生效日为2010年11月15日。

§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、融通领先成长股票基金(LOF)、融通内需驱动股票基金、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、融通医疗保健行业股票基金和融通岁岁添利定期开放债券基金。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		
王建强	本基金基金经理、融通深证100指数基金基金经理、融通巨潮100指数基金(LOF)基金经理、融通创业板指数基金基金经理	2010年11月15日	-	9	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。
李勇	本基金的基金经理、融通创业板指数基金基金经理	2010年11月15日	-	8	研究生学历,具有证券从业资格。2005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。

注:任职日期指公司董事会作出决定之日;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、《融通深证成份指数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 公平交易制度和控制方法

为了保证旗下的不同投资组合得到公平对待,本基金管理人制定了《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、债券的一级市场申购、二级市场交易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活动相关的各个环节。

本基金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、流程和技术手段来保证公平交易原则的实现。同时,本基金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加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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(1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。

4.3.3 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

本基金为被动式指数基金,原则上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,力争实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%、年化跟踪误差控制在4%的投资目标。

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3.15%,同期业绩比较基准收益率为2.25%。沪深300上涨7.55%,从各行业指数的表现来看:房地产(申万)和金融服务(申万)领涨,分别上涨31.73%和19.21%,信息服务(申万)和机械设备(申万)领跌,跌幅超过10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2012年初以来实施的稳增长政策逐渐开始发挥作用,尤其是6、7月份的连续两次降息使得市场整体资金价格有所回落,以及三季度之后政府信用扩张引致基建投资的快速推进以及房地产销售的持续好转,2012年四季度GDP同比增速7.9%,相比于三季度的7.4%回升了0.5个百分点,摆脱了自2011年三季度以来连续7个季度回落的困境,经济进入了温和复苏的通道中。十八大的一个鲜明特色,就是突出"改革",新领导班子也持续释放出了坚定改革的信号,李克强副总理提出"改革是中国最大的红利"。可以预见,改革、改革预期以及衍生的政策预期,将会是推动2013年市场上涨的重要动力。而在2012年12月4日召开的中央政治局会议指出,2013年将以提高经济增长质量和效益为中心,稳中求进,开拓创新,扎实开局,进一步深化改革开放,进一步强化创新驱动,加强和改善宏观调控,积极扩大国内需求,加大经济结构战略性调整力度,着力保障和改善民生,增强经济发展的内生活力和动力,保持物价总水平基本稳定,实现经济持续健康发展和社会和谐稳定。2013年也仍面临着一些不确定性的因素:房价上涨压力的明显攀升,让地产调控再次收紧的可能上升。美国QE的退出、欧债危机的演变等,都将会对经济复苏之路和改革的进程造成冲击。从历史规律看,经济复苏期的股票市场都将迎来较好的表现,因而,在经济处于持续复苏中的过程中,股票市场在13年总体上有望维持一个上升的趋势。经济回升是企业盈利的基本保证,在经济复苏的背景下,市场风格将转向周期性板块,金融、地产、汽车、有色等板块将会有较好的表现。此外,在政策的驱动下,新型城镇化将是未来新政在新形势下推进中国持续增长的重点,与"新型城镇化"相关的基础设施、轨道交通和消费升级的相关板块都将随着政策的深入开展迎来较好的表现机会。

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

截至2012年12月31日,本基金每基金份额可供分配利润为-0.2464元,根据基金合同的约定,本报告期未进行利润分配。

§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

2012年,本基金托管人在对融通深证成份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

2012年,融通深证成份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成份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,融通深证成份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成份指数证券投资基金2012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。

§6 审计报告

本基金2012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(2013)第20525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:融通深证成份指数证券投资基金

报告截止日:2012年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资 产:		
银行存款	45,795,510.15	1,061,566.89
结算备付金	77,376.77	17,238.57
存出保证金	307,514.60	473,029.64
交易性金融资产	851,122,066.79	808,638,023.85
其中:股票投资	851,122,066.79	768,912,023.85
基金投资	-	-
债券投资	-	39,726,000.00
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	32,999,889.85	661,371.37
应收利息	10,199.13	611,977.29
应收股利	-	-
应收申购款	133,830.12	406,610.29
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	930,446,387.41	811,869,817.90
负债和所有者权益	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011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	-	-
应付赎回款	33,104,485.31	443,212.53
应付管理人报酬	726,270.05	714,060.99
应付托管费	145,254.02	142,812.19
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	120,726.76	48,122.22
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	222,554.03	105,551.20
负债合计	34,319,290.17	1,453,759.13
所有者权益:		
实收基金	1,189,108,813.41	1,107,985,877.46
未分配利润	-292,981,716.17	-297,569,818.69
所有者权益合计	896,127,097.24	810,416,058.77
负债和所有者权益总计	930,446,387.41	811,869,817.90

注:报告截止日2012年12月31日,基金份额净值0.754元,基金份额总额1,189,108,813.41份。

7.2 利润表

会计主体:融通深证成份指数证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入	26,946,911.37	-260,865,554.93
1.利息收入	1,099,729.08	1,155,463.63
其中:存款利息收入	189,773.12	363,426.17
债券利息收入	909,955.96	792,037.46
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	-64,468,592.46	19,189,363.09
其中:股票投资收益	-75,804,998.46	9,404,370.25
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-43,320.00	432,570.00
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	11,379,726.00	9,352,422.84
3.公允价值变动收益	90,143,520.26	-282,500,558.73
4.汇兑收益	-	-
5.其他收入	172,254.49	1,290,177.08
二、费用	11,763,538.87	16,528,249.16
1.管理人报酬	8,973,964.78	11,550,891.51
2.托管费	1,794,793.06	2,310,178.22
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	586,096.03	2,256,600.93
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	408,685.00	410,578.50
三、利润总额	15,183,372.50	-277,393,804.09
减:所得税费用	-	-
四、净利润	15,183,372.50	-277,393,804.09

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:融通深证成份指数证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012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)	1,107,985,877.46	-297,569,818.69	810,416,058.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	15,183,372.50	15,183,372.50
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	81,122,935.95	-10,595,269.98	70,527,665.97
其中:1.基金申购款	306,910,198.14	-63,234,673.84	243,675,524.30
2.基金赎回款	-225,787,262.19	52,639,403.86	-173,147,858.33
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)	1,189,108,813.41	-292,981,716.17	896,127,097.24
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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)	1,785,690,040.64	15,286,717.85	1,800,976,758.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-277,393,804.09	-277,393,804.09
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-677,704,163.18	-35,462,732.45	-713,166,895.63
其中:1.基金申购款	334,545,938.38	-10,496,244.88	324,049,693.50
2.基金赎回款	-1,012,250,101.56	-24,966,487.57	-1,037,216,589.13
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)	1,107,985,877.46	-297,569,818.69	810,416,058.77

报表附注为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:

梁星华 颜锡廉 刘美丽

基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

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

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

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")	基金管理人的股东、基金代销机构
日兴资产管理有限公司	基金管理人的股东

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

7.4.4.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的交易佣金。

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 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	8,973,964.78	11,550,891.51
其中:支付销售机构的客户维护费	3,546,689.23	5,709,888.21

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1.0%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×1.0%/当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,794,793.06	2,310,178.22

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0.2%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×0.2%/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。

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

报告期内及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

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,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。

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 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	45,795,510.15	174,831.78	1,061,566.89	343,793.49

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)在承销期承销的证券。

7.4.4.7 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。

7.4.5 期末(2012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
000002	万科A	2012年12月26日	B股转H股	10.62	2013年1月21日	11.13	8,775,691	73,035,475.63	93,197,838.42	-
000527	美的电器	2012年8月27日	资产重组	9.69	-	-	2,179,075	33,372,565.66	21,115,236.75	-

注:本基金截至2012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

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

§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	851,122,066.79	91.47
	其中:股票	851,122,066.79	91.47
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	45,872,886.92	4.93
6	其他各项资产	33,451,433.70	3.60
7	合计	930,446,387.41	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采掘业	50,907,031.93	5.68
C	制造业	457,042,523.82	51.00
C0	食品、饮料	128,058,557.38	14.29
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	17,146,640.00	1.91
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	81,848,023.84	9.13
C7	机械、设备、仪表	171,843,825.03	19.18
C8	医药、生物制品	58,145,477.57	6.49
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	19,157,326.50	2.14
H	批发和零售贸易	29,861,392.75	3.33
I	金融、保险业	113,910,768.87	12.71
J	房地产业	114,995,680.92	12.83
K	社会服务业	32,529,315.00	3.63
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	818,404,039.79	91.33

8.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	13,755,936.59	1.54
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	13,755,936.59	1.54
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,802,987.54	0.98
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	10,159,102.87	1.13
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	32,718,027.00	3.65

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	8,775,691	93,197,838.42	10.40
2	000651	格力电器	2,354,421	60,037,735.50	6.70
3	000858	五粮液	1,888,045	53,299,510.35	5.95
4	000001	平安银行	2,785,891	44,629,973.82	4.98
5	000157	中联重科	4,606,781	42,428,453.01	4.73
6	000069	华侨城A	4,337,242	32,529,315.00	3.63
7	002024	苏宁电器	4,490,435	29,861,392.75	3.33
8	000776	广发证券	1,872,648	28,876,232.16	3.22
9	000568	泸州老窖	734,743	26,009,902.20	2.90
10	000423	东阿阿胶	615,077	24,855,261.57	2.77

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 积极部分前五名

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	000024	招商地产	339,883	10,159,102.87	1.13
2	002081	金螳螂	199,977	8,802,987.54	0.98
3	002241	歌尔声学	199,873	7,535,212.10	0.84
4	002415	海康威视	199,959	6,220,724.49	0.69

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	000002	万科A	15,468,974.45	1.91
2	000858	五粮液	12,773,262.83	1.58
3	000651	格力电器	12,113,191.70	1.49
4	000024	招商地产	9,928,564.71	1.23
5	000425	徐工机械	8,626,986.78	1.06
6	000001	平安银行	8,618,110.93	1.06
7	002081	金螳螂	8,157,060.40	1.01
8	000157	中联重科	7,960,284.78	0.98
9	002024	苏宁电器	7,727,651.40	0.95
10	000401	冀东水泥	7,686,413.06	0.95
11	000069	华侨城A	7,507,926.30	0.93
12	002241	歌尔声学	7,388,037.30	0.91
13	002304	洋河股份	7,342,918.29	0.91
14	000983	西山煤电	6,713,049.31	0.83
15	000402	金融街	6,308,389.31	0.78
16	002415	海康威视	6,255,512.86	0.77
17	000792	盐湖股份	6,203,638.81	0.77
18	000063	中兴通讯	6,088,780.28	0.75
19	000338	潍柴动力	5,885,970.38	0.73
20	000527	美的电器	5,885,222.62	0.73

注:"买入