

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: 2014年3月27日

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法律责任。
基金合同规定,本基金管理人根据融通巨潮100指数证券投资基金(L0F)(以下简称“本基金”)基金合同规定,于2014年3月20日复核了本报告中财务指标、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,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

2.1 基金基本情况

Table with 2 columns: 基金简称, 基金代码, 基金管理人, etc. Details include 融通巨潮100指数(L0F), 161607, 融通基金管理有限公司, etc.

2.2 基金产品说明

Table with 2 columns: 基金合同生效日, 基金管理人, 基金托管人, etc. Details include 2005年5月12日, 融通基金管理有限公司, 中国工商银行股份有限公司, etc.

2.3 基金管理人及基金托管人

Table with 2 columns: 项目, 基金管理人, 基金托管人. Details include 名称, 名称, 信息披露负责人, etc.

2.4 信息披露方式

Table with 2 columns: 基金年度报告正文的全文, 基金管理人互联网网址, etc. Details include www.rtfund.com

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

Table with 4 columns: 本期, 2013年, 2012年, 2011年. Details include 本期已实现收益, 本期基金份额净值增长率, etc.

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。

3.2 基金净值表现

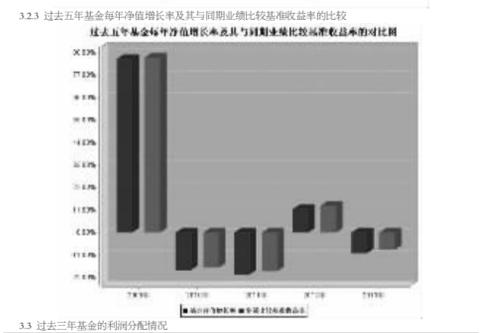
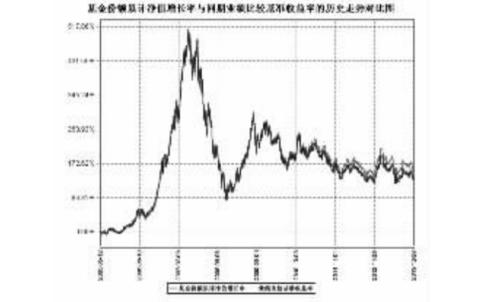


Table with 5 columns: 年度, 每10份基金份额净值, 现金形式发放总额, etc. Details include 2013, 2012, 2011, etc.

3.3 过去三年基金利润分配情况

Table with 5 columns: 年度, 每10份基金份额净值, 现金形式发放总额, etc. Details include 2013, 2012, 2011, etc.

4 基金管理人及基金托管人

4.1 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12500万人民币,本公司的股东及出资比例分别为:新时代证券有限责任公司60%,日兴资产管理(香港)有限公司(Nikko Asset Management Co., Ltd.)40%。

4.2 公平交易制度的执行情况

为了保障旗下不同的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》,公平交易制度的适用范围包括上市股票、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的所有环节。

4.3 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 报告期内本基金的投资策略和业绩表现说明
本基金管理人严格按照基金合同约定的投资范围和比例,在严格控制风险的基础上,积极寻找具有长期增长潜力的优质资产,力争实现超越业绩比较基准的投资目标。

融通巨潮100指数证券投资基金(L0F)

2013 年度 报告摘要

2013年12月31日

展望2014年,我们对A股市场较为谨慎,风格资产的分化趋势大概率将继续维持。如果估值资产或者平台资产的风险不出现释放,全年可能继续维持“既不破也不立”的平淡情形;如果出现一次风险释放,对于中长期来说将出现“破而后立”的走势,从中国经营的外部环境来看,国际环境在改善,美国已经进入启动回升增长的轨道,政策走出超预期,日本经济可能走出长期颓势,从国内的经济环境来看,新的领导核心在致力构建符合未来中长期发展的新蓝图,且重新建立良好社会生态,巨大的经济存量可能产生的环境风险和新的经济增长方式带来的增量在赛跑,毫无疑问,2013年的证券市场充分演绎了对于新经济的期待,进入2014年,证券市场在这一方向上积累的过度预期可能需要一个等待观察的窗口,我们继续看好中小成长股未来发展的空间,但是也谨慎关注着行业性的风险。

4.6 管理人报告期内基金估值程序及说明
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,公开估值方法、估值程序、估值流程清晰,固定收益部、国际业务部和监察稽核部共同组成的估值委员会,通过召开估值委员会会议,参考独立第三方机构估值数据等多种方式的有效结合,减少或避免估值偏差,保证基金估值的准确性和合理性。其中研究部负责提供估值数据,估值委员会成员不包含基金经理,估值委员会定期对估值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,基金在采用新估值政策或投资新品种时,应当评估估值政策和程序的适用性,其中研究部负责提供估值数据,估值委员会成员不包含基金经理,估值委员会定期对估值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、基金会计估值的方法等进行搜集并整理汇总,供估值委员会参考,监察稽核部负责估值业务的事前、事中和事后的审核工作,基金估值不参估值决定,参与估值程序各方之间亦不存在任何重大利益冲突,截至报告期末本公司与外部估值定价服务机构不存在。

4.7 管理人报告期内基金利润分配情况的说明
截至2013年12月31日,本基金每基金份额可供分配利润为-0.4253元,根据基金合同约定,本报告不进行利润分配。

5 托人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵守法律法规情况
报告期内,本基金托管人严格按照《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 托管人对管理人基金估值投资运作遵守情况、净值计算、利润分配等情况的说明
报告期内,融通巨潮100指数证券投资基金(L0F)的管理人——融通基金管理有限公司在融通巨潮100指数证券投资基金(L0F)的投资运作、基金资产净值计算、基金估值申赎赎回核算、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有关规定进行。本报告期内,融通巨潮100指数证券投资基金(L0F)未进行利润分配。

6 审计报告

本基金的2013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特殊普通合伙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(2014)第2120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

Table with 2 columns: 资产, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 货币资金, 银行存款, 结算备付金, etc.

Table with 2 columns: 负债, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 应付赎回款, 应付管理人报酬, 应付托管费, etc.

Table with 2 columns: 所有者权益, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 实收基金, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

Table with 2 columns: 资产, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 货币资金, 银行存款, 结算备付金, etc.

Table with 2 columns: 负债, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 应付赎回款, 应付管理人报酬, 应付托管费, etc.

Table with 2 columns: 所有者权益, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 实收基金, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

Table with 2 columns: 资产, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 货币资金, 银行存款, 结算备付金, etc.

Table with 2 columns: 负债, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 应付赎回款, 应付管理人报酬, 应付托管费, etc.

Table with 2 columns: 所有者权益, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 实收基金, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

Table with 2 columns: 资产, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 货币资金, 银行存款, 结算备付金, etc.

Table with 2 columns: 负债, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 应付赎回款, 应付管理人报酬, 应付托管费, etc.

Table with 2 columns: 所有者权益, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 实收基金, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

Table with 2 columns: 资产, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 货币资金, 银行存款, 结算备付金, etc.

Table with 2 columns: 负债, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 应付赎回款, 应付管理人报酬, 应付托管费, etc.

Table with 2 columns: 所有者权益, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 实收基金, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

Table with 2 columns: 资产, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 货币资金, 银行存款, 结算备付金, etc.

Table with 2 columns: 负债, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 应付赎回款, 应付管理人报酬, 应付托管费, etc.

Table with 2 columns: 所有者权益, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 实收基金, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

Table with 2 columns: 资产, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 货币资金, 银行存款, 结算备付金, etc.

Table with 2 columns: 负债, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 应付赎回款, 应付管理人报酬, 应付托管费, etc.

Table with 2 columns: 所有者权益, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 实收基金, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

Table with 2 columns: 资产, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 货币资金, 银行存款, 结算备付金, etc.

Table with 2 columns: 负债, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 应付赎回款, 应付管理人报酬, 应付托管费, etc.

Table with 2 columns: 所有者权益, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 实收基金, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

Table with 2 columns: 资产, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 货币资金, 银行存款, 结算备付金, etc.

Table with 2 columns: 负债, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 应付赎回款, 应付管理人报酬, 应付托管费, etc.

Table with 2 columns: 所有者权益, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 实收基金, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

Table with 2 columns: 资产, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 货币资金, 银行存款, 结算备付金, etc.

Table with 2 columns: 负债, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 应付赎回款, 应付管理人报酬, 应付托管费, etc.

Table with 2 columns: 所有者权益, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 实收基金, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

Table with 2 columns: 资产, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 货币资金, 银行存款, 结算备付金, etc.

Table with 2 columns: 负债, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 应付赎回款, 应付管理人报酬, 应付托管费, etc.

Table with 2 columns: 所有者权益, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 实收基金, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

Table with 2 columns: 资产, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 货币资金, 银行存款, 结算备付金, etc.

Table with 2 columns: 负债, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 应付赎回款, 应付管理人报酬, 应付托管费, etc.

Table with 2 columns: 所有者权益, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 实收基金, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

Table with 2 columns: 资产, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 货币资金, 银行存款, 结算备付金, etc.

Table with 2 columns: 负债, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 应付赎回款, 应付管理人报酬, 应付托管费, etc.

Table with 2 columns: 所有者权益, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 实收基金, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

Table with 2 columns: 资产, 2013年12月31日, 上年度末, 2012年12月31日. Details include 货币资金, 银行存款, 结算备付金, etc.

Table with 2 columns: 关联方名称, 与本基金的关系. Details include 融通基金管理有限公司, 中国工商银行股份有限公司, etc.

Table with 2 columns: 关联方名称, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日. Details include 新时代证券, 成交金额, 成交笔数, etc.

Table with 2 columns: 关联方名称, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日. Details include 新时代证券, 成交金额, 成交笔数, etc.

Table with 2 columns: 关联方名称, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日. Details include 新时代证券, 成交金额, 成交笔数, etc.

Table with 2 columns: 关联方名称, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日. Details include 新时代证券, 成交金额, 成交笔数, etc.

Table with 2 columns: 项目, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日. Details include 当期发生基金托管费, 当期发生基金托管费, etc.

Table with 2 columns: 项目, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日. Details include 当期发生基金托管费, 当期发生基金托管费, etc.

Table with 2 columns: 项目, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日. Details include 当期发生基金托管费, 当期发生基金托管费, etc.

Table with 2 columns: 项目, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日. Details include 当期发生基金托管费, 当期发生基金托管费, etc.

Table with 2 columns: 项目, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日. Details include 当期发生基金托管费, 当期发生基金托管费, etc.

Table with 2 columns: 项目, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日. Details include 当期发生基金托管费, 当期发生基金托管费, etc.

Table with 2 columns: 项目, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日. Details include 当期发生基金托管费, 当期发生基金托管费, etc.

Table with 2 columns: 项目, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日. Details include 当期发生基金托管费, 当期发生基金托管费, etc.

Table with 2 columns: 项目, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日. Details include 当期发生基金托管费, 当期发生基金托管费, etc.

Table with 2 columns: 项目, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日. Details include 当期发生基金托管费, 当期发生基金托管费, etc.

Table with 2 columns: 项目, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日. Details include 当期发生基金托管费, 当期发生基金托管费, etc.

Table with 2 columns: 项目, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日. Details include 当期发生基金托管费, 当期发生基金托管费, etc.

Table with 2 columns: 项目, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日. Details include 当期发生基金托管费, 当期发生基金托管费, etc.

Table with 2 columns: 项目, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日. Details include 当期发生基金托管费, 当期发生基金托管费, etc.

Table with 2 columns: 项目, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日. Details include 当期发生基金托管费, 当期发生基金托管费, etc.

Table with 2 columns: 项目, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日. Details include 当期发生基金托管费, 当期发生基金托管费, etc.

Table with 2 columns: 项目, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日. Details include 当期发生基金托管费, 当期发生基金托管费, etc.

Table with 2 columns: 项目, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日. Details include 当期发生基金托管费, 当期发生基金托管费, etc.

Table with 2 columns: 项目, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日. Details include 当期发生基金托管费, 当期发生基金托管费, etc.

Table with 2 columns: 项目, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日. Details include 当期发生基金托管费, 当期发生基金托管费, etc.

Table with 2 columns: 项目, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日. Details include 当期发生基金托管费, 当期发生基金托管费, etc.

Table with 2 columns: 项目, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日. Details include 当期发生基金托管费, 当期发生基金托管费, etc.

Table with 2 columns: 项目, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日. Details include 当期发生基金托管费, 当期发生基金托管费, etc.

Table with 2 columns: 项目, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日. Details include 当期发生基金托管费, 当期发生基金托管费, etc.

Table with 2 columns: 项目, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日. Details include 当期发生基金托管费, 当期发生基金托管费, etc.

Table with 2 columns: 项目, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日. Details include 当期发生基金托管费, 当期发生基金托管费, etc.

Table with 2 columns: 项目, 2013年1月1日至2013年12月31日, 2012年1月1日至2012年12月31日. Details include 当期发生基金托管费, 当期发生基金托管费, etc.

8.4.2 累计卖出金额超过期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with 5 columns: 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(%)

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 2 columns: 买入股票成本-成交总额, 卖出股票收入-成交总额

注:“买入股票成本(成交)总额”和“卖出股票收入(成交)总额”均按成交金额(成交)成交金额计算,相关交易费用不在此列。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.6 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

Table with 5 columns: 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(%)

8.7 期末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

8.8 期末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

8.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

8.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

8.11 本基金投资的前十名股票中市值超出本基金合同规定的备选股票情况

8.12 本基金投资的前十名股票中市值超出本基金合同规定的备选股票情况

8.13 本基金投资的前十名股票中市值超出本基金合同规定的备选股票情况

8.14 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

8.15 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.16 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.17 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.18 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.19 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.20 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.21 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.22 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.23 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.24 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.25 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.26 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.27 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.28 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.29 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.30 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.31 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.32 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.33 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.34 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.35 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.36 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.37 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.38 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.39 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.40 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.41 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.42 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.43 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明