

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第一季度报告

2012年3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：2012年4月24日

§1

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子基金融通深证100指数证券投资基金，以下简称“本基金”。2012年第1季度报告。

基金管理人的董事会及高级管理人员保证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、完整性和及时性承担个别及连带责任。

基金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基金合同的规定，于2012年4月20日复核了基金管理人编制的报告内容、净值表现和资产组合报告等内容，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基金招募说明书。

本报告期财务数据未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至2012年3月31日止。

§2

基金产品概况

基金简称 融通深证100指数

基金主代码 161604

交易代码 161604(前端收费模式) | 161654(后端收费模式)

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2006年3月30日

报告期末基金份额总额 14,207,352,590.49份

运用于指数化投资方式，通过挖掘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指数成份股的跟踪误差、风险及收益的控制，分享中国经济持续、稳定的增长和中国证券市场的表现，实现基金资产的长期增值，为投资者带来稳定的资本增值。

投资目标 以深证100以上的企业所持有的深证100指数成份股的股票作为主要投资对象，通过指数化投资方法，跟踪指数成份股部分下跌后基金净值的50%，从而帮助战胜深证100指数的跌幅，对于因流动性因素导致无法实现基金净值深证100指数的情况，将采取剩余合成分额方法来避免误差过大。

投资策略 本基金在实现收益指基本期利润收入、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；

2. 本期利润为持有的基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列示的。

§3

主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

报告期：2012年1月1日 - 2012年3月31日

1. 本期已实现收益 -63,333,353.46

2. 本期利润 618,296,019.60

3. 加权平均基金份额本期利润 0.0439

4. 期末基金份额净值 13,892,383.03934

5. 期末基金资产净值 0.978

注：1.本期实现收益指基金本期利润收入、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；

2. 本期利润为持有的基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列示的。

§3.1

主要财务指标

报告期：2012年1月1日 - 2012年3月31日

1. 主要财务指标

报告期金额

单位：人民币元

报告期：2012年1月1日 - 2012年3月31日

1. 本期已实现收益 -63,333,353.46

2. 本期利润 618,296,019.60

3. 加权平均基金份额本期利润 0.0439

4. 期末基金份额净值 13,892,383.03934

5. 期末基金资产净值 0.978

注：1.本期实现收益指基金本期利润收入、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；

2. 本期利润为持有的基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列示的。

§3.2

基金净值表现

3.2.1 本期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

报告期：2012年1月1日 - 2012年3月31日

阶段

净值增长①

净值增长标准差②

业绩比较基准收益

益率差③

标准差④

①-③

②-④

过去三个月 4.71% 1.63% 5.18% 1.65% -0.47% -0.02%

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

报告期：2006年3月30日 - 2012年3月31日

阶段

净值增长①

净值增长标准差②

业绩比较基准收益

益率差③

标准差④

过去三个月 4.71% 1.63% 5.18% 1.65% -0.47% -0.02%

3.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期：2012年1月1日 - 2012年3月31日

序号 行业类别

公允价值(元)

占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 50,036,627.64 0.36

B 采掘业 930,750,458.58 6.70

C 制造业 7,793,276,691.15 56.10

D 食品、饮料 1,830,049,769.64 13.17

E 木材、家具 0 0

F 造纸、印刷 0 0

G 石油、化学、塑胶、塑料 465,372,177.85 3.35

H 电子 383,025,105.30 2.76

I 金属、非金属 1,702,626,530.33 12.26

J 机械、设备、仪表 2,681,270,681.69 19.30

K 医药、生物制品 731,232,434.34 5.26

L 其他制造业 0 0

M 电力、煤气及水的生产和供应业 90,839,500.42 0.65

N 建筑业 72,373,282.80 0.52

O 交通运输、仓储和邮电通信业 0 0

P 信息技术业 379,676,695.40 2.73

Q 批发和零售业 577,570,703.35 4.16

R 金融、保险业 1,193,141,083.99 8.59

S 房地产业 1,347,985,002.18 9.70

T 社会服务业 198,161,245.66 1.43

U 传播与文化产业 167,281,284.81 1.20

V 合计 354,836,178.22 2.55

3.4 报告期内积极调整按行业分类的股票投资组合

报告期：2012年1月1日 - 2012年3月31日

序号 行业类别

公允价值(元)

占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 800,623,778.04 5.76

B 采掘业 650,799,738.80 4.68

C 制造业 486,732,626.35 3.50

D 食品、饮料 472,203,702.75 3.40

E 木材、家具 357,545,345.15 3.29

F 造纸、印刷 393,289,526.70 2.83

G 电子 342,722,636.52 2.47

H 电力、煤气及水的生产和供应业 314,253,687.51 2.26

I 交通运输、仓储和邮电通信业 300,486,901.77 2.16

J 建筑业 260,910,984.96 1.88

3.5 报告期末按行业分类的债券投资组合

报告期：2012年1月1日 - 2012年3月31日

序号 债券品种

公允价值(元)

占基金资产净值比例(%)

A 国家债 50,095,000.00 0.36

B 行业票据 96,740,000.00 0.70

C 金融债 380,811,000.00 2.74

D 中央企业债 380,811,000.00 2.74

E 企业债 0 0

F 短期融资券 0 0

G 可转债 0 0

H 其他 527,646,000.00 3.80

3.6 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股票投资明细

报告期：2012年1月1日 - 2012年3月31日

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(%)

1 000027 万科A 96,493,693 5.76

2 000888 五粮液 17,526,000 1.20

3 000651 格力电器 23,941,595 1.60

4 002024 苏宁电器 48,431,149 3.40

5 000001 深万科A 29,124,465 2.19

6 00157 中国重汽 45,414,495 3.29

7 000663 中兴通讯 20,859,564 1.47

8 002304 泰康人寿 2,135,601 0.15

9 00568 沪市老股 300,486,901.77 2.16

10 00527 美的集团 198,866,508 1.88

3.7 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债券投资明细

报告期：