

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 提示
基金管理人的董事、监事、高级管理人员及其他从事基金运作的人员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。基金托管人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。

融通基金管理有限公司、中国工商银行股份有限公司对本基金合同文本的修订、修改和补充，以及对本基金合同条款的任何变更，均须经中国证监会批准。

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。

本年度报告摘要节录自年度报告全文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告中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无保留意见的审计报告，报告文号见年度报告全文。

本报告期自2012年1月1日起至2012年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称 融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)

基金代码 161607

前端交易代码 161607

后端交易代码 161657

上市契约型开放式(LOF)

基金合同生效日 2005年5月12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

报告期末基金资产总额 2,674,500,957.78

基金合同存续期 不定期

基金份额上市的证券交易所 深圳证券交易所

上市日期 2005-06-16

2.2 基金产品说明

本基金为增强型指数基金，在控制股票投资组合相对大盘指数跟踪误差的基础上，力求获得超越指数100目标指数的投资收益，追求长期的资本增值。本基金将充分掌握中国经济的持续、稳定增长和中国证券市场发展的实际情况，实现基金财产的长期增长，为投资者带来稳定的回报。

本基金以量化分散投资为主要投资策略，在此基础上进行适度的主动调整，在数量化投资技术与基本面深入研究的基础上寻求基金投资组合在跟踪误差及超额收益间的最佳匹配，为控制基金偏离目标指数的风险，本基金力求保持基金净值增长率与目标指数增长率达到的跟踪误差控制在±5%以内。

业绩比较基准 巨潮100指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。

风险收益特征 风险和预期收益率接近年平均水平。

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

姓名 徐玉东 赵会军

信息披露负责人 电话 (0755)26948666 (010)66105799

电子邮件 service@rtfund.com custody@icbc.com.cn

客户服务电话 400-893-9988 (0755) 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 www.rtfund.com

基金年度报告备置地点 基金管理人、基金托管人处,深圳证券交易所

6.3 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

3.1.1 期间数据和指标

2012年 2011年 2010年

本期已实现收益 -219,596,169.17 -181,936,678.95 -192,394,509.08

本期利润 229,902,677.66 -521,059,973.27 -651,905,672.09

加权平均基金份额本期利润 0.0839 -0.1794 -0.1998

本期基金份额净值增长率 11.45% +20.53% +18.39%

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 -0.3382 -0.2840 -0.1950

期末基金资产净值 2,134,850,968.86 2,042,976,541.06 2,727,408,226.87

期末基金份额净值 0.798 0.716 0.901

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金净值增长率与其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② (%) 业绩比较基准收益率③ (%) 业绩比较基准收益率④ (%)

过去三个月 11.30% 1.21% 11.74% 1.19% -0.44% 0.02%

过去六个月 5.14% 1.15% 5.85% 1.13% -0.71% 0.02%

过去一年 11.45% 1.18% 13.10% 1.15% -1.65% 0.03%

过去三年 -27.72% 1.32% -23.91% 1.30% -3.81% 0.02%

过去五年 -51.82% 1.88% -47.45% 1.86% -4.37% 0.02%

自基金合同生效起至今 165.78% 1.81% 183.85% 1.80% -18.07% 0.01%

3.2.2 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变动的比较

基金名称 融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)

基金简称 融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)

基金代码 161607

基金类型 增强型指数基金

上市地 深圳证券交易所

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

基金合同生效日 2005年5月12日

基金募集结束日 2005年5月12日

基金存续期 不定期

基金类别 增强型指数基金

基金规模 165.78亿份

基金总资产 2,134,850,968.86

基金总负债 2,042,976,541.06

基金份额净值 0.798

基金份额净值增长率 11.45%

同期业绩比较基准收益率 13.10%

差额 -1.65%

差额占比 -1.24%

差额占比 -1.24%