

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
送款日期:2013年3月29日

§ 1 重要提示

融通通利系列证券投资基金由融通基金管理有限公司、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构成。本年度报告摘要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年度报告摘要。

基金管理人的董事会、监事会在本基金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。

本年度报告摘要要简要分析,投资者欲了解详细内容,请阅读年度报告正文。

本报告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。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	融通深证100指数
基金主代码	161604
前端交易代码	161604
后端交易代码	161604
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
报告期末基金份额总额	15,247,940,461.07份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

运用指数化投资方式,通过控制股票投资组合与深证100指数的跟踪误差,力求实现深证100指数的有效跟踪,谋求分享中国经济的增长长期稳定的回报。

投资策略

股票指数化投资部分不低于基金资产的50%,采用复制法跟踪深证100指数,对于因波动等而原因导致无法完全复制深证100指数的情况,将采用剩余组合替换等方法避险跟踪误差扩大。

业绩比较基准

深证100指数收益率×95%+银行同期存款利率×5%

风险收益特征

风险和预期收益接近市场平均水平

2.3 基金管理人和基金托管人

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

信息披露义务人:融通基金管理有限公司

联系人:徐卫东

联系电话:(0755)26948666

电子邮箱:service@rtfund.com

客户服务电话:400-883-8088,(0755)26948088

传真:(0755)26935005

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:基金管理人处、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
本期已实现收益	-1,095,304,729.46	-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

本期基金份额净值增长率

2.14% -29.66% -3.66%

3.1.2 期末数据和指标

2012年末 2011年末 2010年末

本期可供分配基金份额利润 -0.0804 -0.0665 0.0138

期末基金资产净值 14,547,973,622.39 12,807,082,759.36 15,986,578,174.92

期末基金份额净值 0.954 0.934 1.341

注:所含基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计算费用后实际收益水平将低于上述列示数字。

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为扣除期末尚未实现部分为正数时,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,如期末未分配利润的末实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未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%

过去三年 -30.78% 1.46% -28.72% 1.46% -2.06% 0.00%

过去五年 -44.45% 1.95% -42.41% 1.95% -2.04% 0.00%

自基金合同生效起至今 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日前含此日止采用“深证100指数收益率×75%+银行间同业存款利率×2.5%”,2005年8月22日起使用新基准即“深证100指数收益率×95%+银行间同业存款利率×5%”。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位:人民币元

3.2.3 过去五年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

单位:人民币元

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

4.1 管理人报告

4.1.1 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]16号文批准,于2001年5月21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:为新时代证券有限责任公司60%、日本资产管理有限公司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,即融通通利封闭基金,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)、融通货币基金、融通动力先锋混合基金、融通领先成长基金、基金巨潮100指数基金(LOF)、融通货币基金、融通巨潮100指数基金(LOF)、融通货币基金、融通货币基金、融通深证成份指数基金、融通四季添利债券基金、融通行业指数基金、融通医疗保健行业基金、融通债券基金、融通四季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 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

王建强 2009年5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5月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:任职日期根据基金管理人对外披露的免任日期填写;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遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金严格遵守《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,为基金份额持有人谋取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。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 公平交易制度的执行情况

为了保证旗下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”,即执行公平交易制度的严格执行。

本基金定期对报告期内不同投资组合之间交易行为进行了分析,各投资组合之间的交易行为的公平性得到了公平交易的原则和制度。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

本基金报告期内未发生异常情况。

4.5 管理人对报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

在严格遵守基金合同的前提下,本基金运用指数化投资方式,通过对股票投资权重及深证100指数成份股自然权重的偏离控制,减少基金相对深证100指数的跟踪误差,力求

最终实现对深证100指数的有效跟踪。

2012年的A股证券市场出现了大幅波动,从组成指数的各行业类指数表现来看,表现

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

大不相同:其中房地产和非银金融涨幅超过30%;计算机、电力设备、通信行业跌幅超过10%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金的净值增长率为2.14%,基金份额比较基准收益率为3.32%。

4.4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

展望2013年,我们对国内市场较为乐观。从国内经济金融环境及国内情况来看,不确定性和负面影响明显减弱,2013年新的增长方式增长将更吸引投资者的目光。从国际情况来看,美国开始进入较为稳定的增长的轨道,欧洲债务状况至少不会深次次恶化,发展中国家继续保持较为稳定的增长;从国内经济情况来看,随着国内经济环境的改善,内嵌版的平稳过渡,新型城镇化的战略思想可能将使企业投资保持在较为稳定的增长的状态。综合国内外的情况来看,在不确定性的减少的情况下,企业投资可能将更偏向于较为稳定的增长,企业投资的预期将得到较好的抑制作用。通货膨胀率较快的降低就能得到缓解。

4.4.4 管理人对报告期内基金估值政策和会计政策的说明

本报告期未对基金的估值政策和会计政策进行调整。

4.4.5 管理人对重要事项的说明

本报告期未对重要事项进行说明。

4.4.6 会计政策

本基金的会计政策在本报告期未发生重大变化。

4.4.7 会计估计

本基金的会计估计在本报告期未发生重大变化。

4.4.8 会计差错

本基金在本报告期未发生重大差错。

4.4.9 其他重要事项

本基金在本报告期未发生其他重要事项。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:奚星华 主管会计工作负责人:颜锡廉 会计机构负责人:刘

美丽

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、会计估计与最近一年度报告相一致。

7.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无重大差错更正。

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

中国工商银行股份有限公司 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”) 基金管理人股东、基金代销机构

日信资产 管理人

注:“买入金额”是指买入股票成交金额,即成交单价乘以成交量,相关交易费用不考虑。

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 000063 中兴通讯 165,971,750.01 1.30