

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
 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构成。本年度报告摘要为融通通利系列证券投资基金之基金通利深证100指数证券投资基金(以下简称“本基金”)2012年年度报告摘要。

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本基金合同规定,于2013年3月26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标准无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期内自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
前缀交易代码	161604
后缀交易代码	161654
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	
投资目标	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,力求实现对深证100指数的有效跟踪,谋求分享中国经济的持续、稳定增长和中国证券市场的发展,实现基金资产的长期增长,为投资者带来稳定回报。
投资策略	以非债券资产90%以上的资金对深证100指数的成份股进行股票指数投资。股票指数化投资组合不得低于基金资产的50%,采用指数化跟踪深证100指数,对于因流动性等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免跟踪误差扩大。
业绩比较基准	深证100指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%
风险和收益特征	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	
名称	融通基金管理有限公司
信息负责人	徐卫东
电 话	(0755)26948666
负 责 人 电 话	(010)66105799
电子邮箱	service@mail.ttfund.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.ttfund.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
本期已实现收益	-1,095,504,729.46
本期利润	250,690,807.23
加权平均基金份额本期利润	0.0170
本期基金份额净值增长率	2.14%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0804
期末基金资产净值	14,547,973,622.39
期末基金份额净值	0.954

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)。

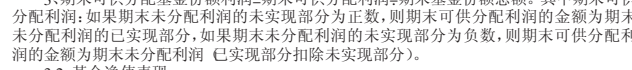
3.2 基金净值表现

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

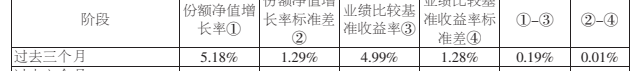
阶段	份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	份额净值增长率③-业绩比较基准收益率④
过去三个月	5.18%	1.29%	4.99%
过去六个月	-3.64%	1.34%	-3.32%
过去一年	2.14%	1.38%	1.38%
过去三年	-30.78%	1.46%	-28.72%
过去五年	-44.45%	1.95%	-42.41%
自基金合同生效起至今	181.86%	1.77%	223.29%

注:本基金业绩比较基准项目分段计算,其中:2005年8月21日之前(含日)采用“深证100指数×75%+银行同业存款综合指数×25%”,2005年8月22日起使用新基准即“深证100指数×95%+银行同业存款利率×5%”。

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

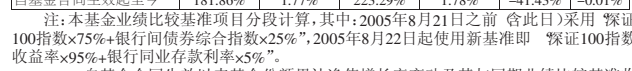


3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:1、本基金业绩比较基准项目分段计算,其中:2005年8月21日之前(含日)采用“深证100指数×75%+银行同业存款综合指数×25%”,2005年8月22日起使用新基准即“深证100指数×95%+银行同业存款利率×5%”。

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



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

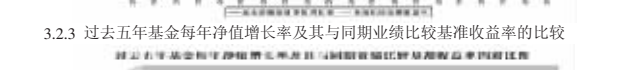


注:1、本基金业绩比较基准项目分段计算,其中:2005年8月21日之前(含日)采用“深证100指数×75%+银行同业存款综合指数×25%”,2005年8月22日起使用新基准即“深证100指数×95%+银行同业存款利率×5%”。

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



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



注:1、本基金业绩比较基准项目分段计算,其中:2005年8月21日之前(含日)采用“深证100指数×75%+银行同业存款综合指数×25%”,2005年8月22日起使用新基准即“深证100指数×95%+银行同业存款利率×5%”。

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

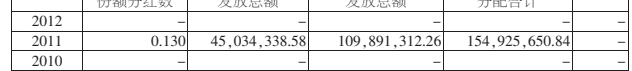


3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

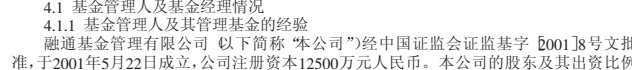


注:1、本基金业绩比较基准项目分段计算,其中:2005年8月21日之前(含日)采用“深证100指数×75%+银行同业存款综合指数×25%”,2005年8月22日起使用新基准即“深证100指数×95%+银行同业存款利率×5%”。

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

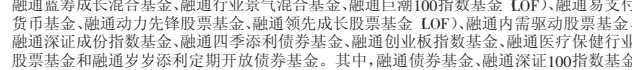


3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

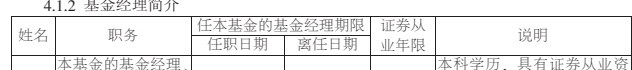


注:1、本基金业绩比较基准项目分段计算,其中:2005年8月21日之前(含日)采用“深证100指数×75%+银行同业存款综合指数×25%”,2005年8月22日起使用新基准即“深证100指数×95%+银行同业存款利率×5%”。

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

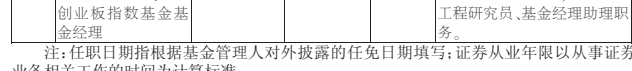


3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

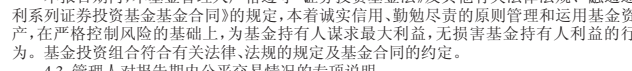


注:1、本基金业绩比较基准项目分段计算,其中:2005年8月21日之前(含日)采用“深证100指数×75%+银行同业存款综合指数×25%”,2005年8月22日起使用新基准即“深证100指数×95%+银行同业存款利率×5%”。

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

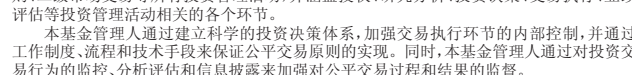


3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

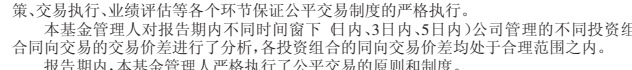


注:1、本基金业绩比较基准项目分段计算,其中:2005年8月21日之前(含日)采用“深证100指数×75%+银行同业存款综合指数×25%”,2005年8月22日起使用新基准即“深证100指数×95%+银行同业存款利率×5%”。

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

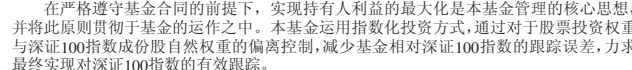


3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:1、本基金业绩比较基准项目分段计算,其中:2005年8月21日之前(含日)采用“深证100指数×75%+银行同业存款综合指数×25%”,2005年8月22日起使用新基准即“深证100指数×95%+银行同业存款利率×5%”。

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



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

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

报告期内本基金份额净值增长率为2.14%,基金业绩比较基准收益率为3.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2013年,我们对A股市场较为乐观。从国际经济金融环境及国内情况来看,不确定性和负面因素明显减少,2013年,新的增长方式和增长点将更吸引投资者的目光。从国际情况来看,美国开始进入较为确定的稳定向上增长的轨道,欧洲债务状况至少不会深层次恶化,发展中国家继续保持较为稳定的增长;从国内情况来看,随着外部经济环境的改善,内部换届的平稳过渡,新型城镇化的指导思想可能使投资增速维持在较为温和的状态。综

合国内外的情况来看,在不确定性减少的情况下,企业部门收缩杠杆的意愿可能会发生变化,居民部门在保障程度提高的情况,加杠杆的能力在提高。上市公司整体盈利能力,在今天的中国以后可能比系统性地同比增长情形。对于普通投资者来说,我们预期的业绩与估值的双击局面可能会出现,需要重点警惕的是通货膨胀的速度超预期。从目前的情况来看,近期对于影子银行及地方融资平台的一些抑制措施对于地方投资的高速增长如果能

能有较好的抑制作用,通货膨胀上涨较快的风险能得到化解。

总体而言,证券市场中长期的持续增长趋势的明确需要继续观察政策红利释放的可能性,短期的增长趋势来自于温和的周期性及所带来的风险下降和盈利回升。

4.6 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时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、基金估值方法的法规等进行搜索并整理汇总,估值委员会参考,监察稽核部负责基金估值业务的事前、事中和事后的审核工作。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机构签订服务协议。

4.7 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-0.0804元,依据基金合同的约定,不进行利润分配。

§ 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100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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2012年,融通深证100指数证券投资基金的托管人 融通基金管理有限公司在融通深证100指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金估值和申购赎回价格计算、基金费用支出等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在基金合同约定的工作严格按照基金合同的约定进行。本报告期内,融通深证100指数证券投资基金未进行利润分

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

基金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100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20513号),投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

7.1 资产负债表

单位:人民币元

资产

2012年12月31日

2011年12月31日

资产:

银行存款 283,346,907.89

结算备付金 1,869,068.89

存出保证金 2,581,190.32

交易性金融资产 14,286,307,434.51

其中:股票投资 13,577,990,434.51

基金投资 -

债券投资 528,317,000.00

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 6,753,288.34

应收股利 7,200,101.19

应收申购款 37,829,676.04

其他应收款 -

递延所得税资产 -

其他资产 -

资产总计 14,618,687,565.99

负债和所有者权益

2012年12月31日

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 775,844.62

应付赎回款 50,887,896.57

应付管理人报酬 11,433,627.52

应付托管费 2,286,725.49

应付销售服务费 -

应付交易费用 2,738,510.76

应付税费 -

应付利息 -

应付利润 -

递延所得税负债 -

其他负债 2,591,338.64

负债合计 70,713,943.60

所有者权益:

实收资本 15,247,940,461.07

未分配利润 -699,966,838.68

所有者权益合计 14,547,973,622.39

负债和所有者权益总计 14,618,687,565.99

注:报告截止日2012年12月31日,基金份额净值0.954元,基金份额总额15,247,940,461.07份。

7.2 利润表

单位:人民币元

项目

2012年1月1日至2012年12月31日

2011年1月1日至2011年12月31日

一、收入

1.利息收入 41,687,008.18

2.投资收益 23,257,268.14

其中:存款利息收入 1,690,199.92

债券利息收入 19,934,970.91

资产支持证券利息收入 -

买入返售金融资产收入 32,097.31

其他利息收入 -

2.投资收益 -935,764,366.49

其中:股票投资收益 -1,103,377,003.50

基金投资收益 -86,127,119.87

债券投资收益 -255,880.00

资产支持证券投资 -

衍生工具收益 -

股利收益 167,868,517.01

3.公允价值变动收益 1,346,195,536.69

4.汇兑收益 -

5.其他收入 1,379,569.84

二、费用 182,777,200.95

1.管理费 141,771,478.49

2.托管费 28,354,295.66

3.销售服务费 -

4.交易费用 12,326,597.00

5.利息支出 -

其中:卖出回购金融资产支出 -

6.其他费用 324,829.80

三、利润总额 250,690,807.23

减:所得税费用 -

四、净利润 250,690,807.23