

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8月27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。本报告摘要为融通通利系列证券投资基金之基金融通深证100指数证券投资基金(以下简称“本基金”)2013年半年度报告摘要。

基金管理人、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。本半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《融通通利系列证券投资基金合同》规定,于2013年8月22日复核了本基金本报告期内财务指标、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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告期内财务资料未经审计。

基金合同于2013年1月1日起至6月30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
基金代码	161604
前十大交易代码	161604
后十大交易代码	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(以下简称“中国工商银行”)
报告期末基金份额总额	14,944,823,263.14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%以上的资产对深证100指数的成份股进行股票数字化投资。股票数字化投资部分不得低于基金资产的50%,采用复制法跟踪深证100指数,对于流动性等限制因素无法完全复制深证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%
风险收益特征	风险和预期收益水平接近市场平均水平

2.3 基金管理人及基金托管人

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
信息	姓名: 涂东	赵会军
披露联系人	联系电话: 029-68948666	(010)66105799
负责人	电子邮箱: service@mail.rtfund.com	custserv@icbc.com.cn
客户服务热线	400-883-8088、(0755)26948088	95588
传真	(0755)26935005	(010)66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	-400,942,585.76
本期利润	-1,372,465,128.80
加权平均基金份额本期利润	-0.0912
本期基金份额净值增长率	-9.75%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1385
期末基金资产净值	12,874,359,602.52
期末基金份额净值	0.861

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、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	份额净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率基准④	①-③	②-④
过去一个月	-15.34%	1.99%	-15.52%	1.98%	0.18%	0.01%
过去三个月	-9.56%	1.51%	-9.42%	1.51%	-0.14%	0.00%
过去六个月	-9.75%	1.47%	-9.15%	1.45%	-0.60%	0.02%
过去一年	-13.03%	1.40%	-12.08%	1.39%	-0.95%	0.01%
过去三年	-13.91%	1.43%	-10.95%	1.43%	-2.96%	0.00%
自基金合同生效起至今	154.38%	1.76%	193.72%	1.76%	-39.34%	0.00%

注:本报告中的基金业绩比较基准表现分设计算,其中:2005年8月21日(含)日之前采用“深证100指数×75%+银行间债券综合指数×25%”,2005年8月22日起使用新基准即“深证100指数收益率×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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 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12500万元人民币。本公司的股东及其出资比例:新时代证券有限责任公司60%、兴证资产管理有限公司(Nikko Asset Management Co., Ltd.)40%。

截至2013年6月30日,公司管理的基金共有二十一只。一只封闭式基金,即融通乾封闭基金;十九只开放式基金,即融通蓝筹成长基金、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)、融通动力先锋股票基金、融通动力先锋股票基金(LOF)、融通内需驱动股票基金、融通深证成份指数基金、融通四季添利债券基金、融通创业板指数基金、融通医疗保健行业股票基金、融通岁利添利定期开放债券基金、融通季利四分法 QDI-FOF 基金、融通7天理财债券基金、融通标普中国可转债指数增强基金和融通蓝筹保本混合基金。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通利系列证券投资基金。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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
王建强	本基金的基金经理、融通巨潮100指数基金(LOF)基金经理、融通深证成份指数基金基金经理、融通创业板指数基金基金经理	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、基金经理。

注:任职日期指根据基金管理人对外披露的任职日期填写;证券从业年限指从事证券业务相关工作的时间为计算标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《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,为基金持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为。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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
本基金管理人一贯坚持公平对待旗下所有投资组合的原则,在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节严格执行公平交易制度的严格程序。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
在严格遵守基金合同的前提下实现持有人利益的最大化是本基金管理的核心思想,并将此原则贯彻于基金的运作之中。本基金运用指数化投资方式,竭力通过控制股票投资组合与深证100指数成份股自然权重的偏差,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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金净值增长率为-9.75%,业绩比较基准收益率为-9.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
回顾上半年的市场表现,证券市场的预期变化(由春节前的反复震荡至春节后的弱复苏直至无复苏,四月份以后对于银行理财产品泛滥带来的流动性收紧及6月份由于结构性行情流动性危机引发的恐慌使得证券市场在上半年主体资产产生)进行了较大的调整。我们认为中国宏观经济将保持较长时间的中长期调整及下半年美国退出带来的全球流动性紧缩的影响将对市场主体资产继续产生中长期的负面影响,以传统产业为基础的的大盘股及沪深300指数等将继续保持较长时间的低迷,市场的估值溢价及交易的活跃主要将集中在创业板及龙头个股上,但我们也需要警惕周期性成长在其主营业务进一步下滑时可能面临的业绩不达预期和估值下降的双重风险,整体来看,下半年风险和机遇的时间段会持续到四季度。

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、风险管理部、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,通过参考行业估值意见、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

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

【2013】半年度报告摘要

偏倚的发生。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适用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,风险管理部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、基金会计估值方法的法规等进行搜集并整理汇总,供估值委员会参考,监察稽核部负责基金估值业务的事中、事后及时的审核工作。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,截至报告期末公司与外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明
本基金本报告期末进行利润分配,符合相关法律法规及基金合同的规定。

§ 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
本报告期内,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运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
本报告期内,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、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,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规定进行。本报告期内,融通深证100指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见
本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2013年上半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表	报告截止日:2013年6月30日
资产:	
银行存款	207,879,080.03
结算备付金	2,977,779.01
存出保证金	539,776.45
交易性金融资产	12,770,316,803.81
其中:股票投资	12,131,605,803.81
基金投资	-
债券投资	638,711,000.00
资产支持证券投资	528,317,000.00
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	15,846,853.01
应收股利	6,753,288.34
应收申购款	21,586,692.87
递延所得税资产	37,829,676.04
其他资产	-
资产总计	13,019,146,985.18
负债和所有者权益	
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	111,191,578.73
应付赎回款	14,450,960.74
应付管理人报酬	11,537,547.65
应付托管费	2,307,509.53
应付销售服务费	2,286,725.49
应付交易费用	2,824,618.27
应交税费	2,738,510.76
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	2,475,167.74
负债合计	144,787,382.66
所有者权益:	
实收基金	14,944,823,263.14
未分配利润	-2,070,463,660.62
所有者权益合计	12,874,359,602.52
负债和所有者权益总计	13,019,146,985.18

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.861元,基金份额总额14,944,823,263.14份。

资产:	2013年6月30日	2012年12月31日
银行存款:	207,879,080.03	283,346,907.89
结算备付金	2,977,779.01	1,869,068.89
存出保证金	539,776.45	2,581,190.32
交易性金融资产	12,770,316,803.81	14,286,307,434.51
其中:股票投资	12,131,605,803.81	13,757,990,434.51
基金投资		
债券投资	638,711,000.00	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		
应收利息	15,846,853.01	6,753,288.34
应收股利		
应收申购款	21,586,692.87	37,829,676.04
递延所得税资产		
其他资产		
资产总计	13,019,146,985.18	14,618,687,565.99

注:本报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.861元,基金份额总额14,944,823,263.14份。

资产：		
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	111,191,578.73	775,844.62
应付赎回款	14,450,960.74	50,887,896.57
应付管理人报酬	11,537,547.65	11,433,627.52
应付托管费	2,307,509.53	2,286,729.45
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,824,618.27	2,738,510.76
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	2,475,167.74	2,591,338.64
负债合计	144,787,382.66	70,713,943.60
所有者权益：		
实收基金	14,944,823,263.14	15,247,940,461.07
未分配利润	-2,070,463,660.62	-699,966,838.68
所有者权益合计	12,874,359,602.52	14,547,973,622.39
负债和所有者权益总计	13,019,146,985.18	14,618,687,565.99

注:本报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.861元,基金份额总额14,944,823,263.14份。

会计主体:融通深证100指数证券投资基金		
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日		
单位:人民币元		
项 目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入	-1,276,744,166.67	847,568,766.84
1.利息收入	9,984,798.35	11,303,757.56
其中:存款利息收入	702,101.36	976,525.54
债券利息收入	9,281,188.63	10,308,890.70
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,508.36	18,341.32
其他利息收入	-	-
2.投资收益	-315,777,935.30	-57,472,945.22
其中:股票投资收益	-422,528,289.05	-147,923,555.76
基金投资收益	-	-
债券投资收益	20,000.00	-10,800.00
资产支持证券投资收益	-	-

注:本报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.861元,基金份额总额14,944,823,263.14份。

4.投资收益	-571,513.32	814,616.27
5.其他收入	571,513.32	814,616.27
减:二、费用	95,720,962.13	92,307,979.84
1.管理人报酬	72,782,395.28	72,493,093.26
2.托管费	14,556,479.05	14,498,616.66
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	8,220,957.32	5,155,613.68
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	161,130.48	160,654.24
三、利润总额	-1,372,465,128.80	755,260,787.00
减:所得税费用	-	-
四、净利润	-1,372,465,128.80	755,260,787.00

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:融通深证100指数证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

注:本报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.861元,基金份额总额14,944,823,263.14份。

项目	2013年1月1日至2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	15,247,940,461.07	-699,966,838.68	14,547,973,622.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,372,465,128.80	-1,372,465,128.80
三、本期基金份额交易产生的基金份额变动数	-303,117,197.93	1,968,306.86	-301,148,891.07
其中：1.基金申购款	1,520,034,869.17	-35,100,940.97	1,484,933,928.20
2.基金赎回款	-1,823,152,067.10	37,069,247.83	-1,786,082,819.27
四、本期基金应计持有入分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	14,944,823,263.14	-2,070,463,660.62	12,874,359,602.52
项目	上年度可比期间		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	13,719,041,075.95	-911,958,316.59	12,807,082,759.36

注:本报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.861元,基金份额总额14,944,823,263.14份。

基金净值变动数	1,076,417,923.70	3,741,845.21	1,080,159,768.91
其中:1.基金申购款	2,549,924,050.58	50,166,296.78	2,600,090,347.36
2.基金赎回款	-1,473,506,126.88	-46,424,451.57	-1,519,930,578.45
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	14,795,458,999.65	-152,955,684.38	14,642,503,315.27

注:后附6.4报表附注为本财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

基金管理机构负责人:奚星华 主管会计工作负责人:朱建华 会计机构负责人:刘美丽

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期间度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期间度报告一致。

6.4.2 差错更正的说明

6.4.3 本基金本报告期无重大的会计差错的内容和更正金额。

注:本报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.861元,基金份额总额14,944,823,263.14份。

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。							
6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方							
<table><tr><th>关联方名称</th><th>与本基金的关系</th></tr><tr><td>融通基金管理有限公司</td><td>基金管理人、注册登记机构、基金销售机构</td></tr><tr><td>中国工商银行</td><td>基金托管人、基金代销机构</td></tr></table>	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	基金托管人、基金代销机构	
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	基金托管人、基金代销机构						
注：下述关联交易均在正常业务范围内控一般商业条款订立。							
6.4.3.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易							
6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易							
本基金本报告期无通过关联方交易单元进行关联交易。							