

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

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深证成份指数证券投资基金基金合同规定,于2013年8月22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。

本报告中文财务资料未经审计。

本报告自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	融通深证成份指数
基金代码	161612
前端交易代码	161612
后端交易代码	161662
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年11月15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	1,002,412,048.14份
基金合同存续期	不确定

2.2 基金产品说明	
投资目标	本基金采取完全复制方法进行指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%以内,以实现沪深300指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金,原则上采用完全复制指数的投资策略,按照成份股在标的指数中的基准权重构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整,力争实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%的投资目标。
业绩比较基准	深证成份指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,属于高风险高收益的基金品种,其收益和风险均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人	基金托管人	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
信息披露负责人	姓名 徐卫东	赵会军
联系电话	(0755)26948666	(010)66105799
电子邮箱	service@mail.rtfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	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、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	金额单位:人民币元
3.1.1 期间数据和指标	报告期末(2013年1月1日至2013年6月30日)
本期已实现收益	-46,141,050.88
本期利润	-108,468,415.59
加权平均基金份额本期利润	-0.1012
本期基金份额净值增长率	-14.99%
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	-0.3587
期末基金资产净值	642,813,851.24
期末基金份额净值	0.641

注:0 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;

① 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;

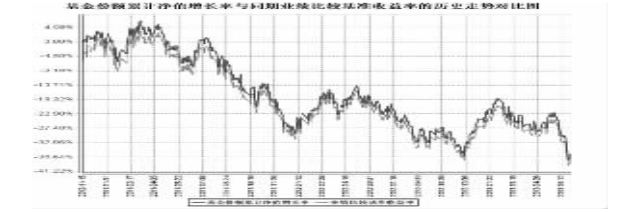
② 期末可供分配基金份额利润=期末可供分配收益/期末基金份额总额;其中期末可供分配利润:如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期未未分配利润的正实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期未未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

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	业绩比较基准增长率②	基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去一个月	-15.66%	1.96%	-16.10%	1.95%	0.44%	0.01%
过去三个月	-12.31%	1.50%	-12.78%	1.50%	0.47%	0.00%
过去六个月	-14.99%	1.50%	-14.81%	1.47%	-0.18%	0.03%
过去一年	-17.50%	1.41%	-18.03%	1.39%	0.53%	0.02%
自基金合同生效起至今	-35.90%	1.34%	-37.77%	1.37%	1.87%	-0.03%

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,公司注册资本为12500万元人民币。本公司的股东及出资比例:新时代证券有限责任公司60%、日兴资产管理(香港)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只:一只封闭式基金,即融通通财封闭基金;十九只开放式基金,即融通蓝筹混合基金、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)、融通易支付货币基金、融通动力先锋股票基金、融通领先成长股票基金(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、融通岁添利定期开放债券基金、融通丰利四方法 QDII-FOF 基金、融通七天理财债券基金、融通沪深300可转债指数增强基金和融通通财保本混合基金。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 基金经理或基金经理小组及基金经理助理简介

姓名	职务	限	任	离	券	说
			任日期	任日期	年限	明
王 建 强	本基金基金经理、融通深证100指数基金基金经理、融通巨潮100指数基金(LOF)基金经理、融通创业板指数基金基金经理	2010年11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,历任金融助理研究员、基金经理助理。
李 勇	本基金的创业板指数基金基金经理	2010年11月15日	-	-	8	研究生学历,具有证券从业资格。2005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。

注:任职日期指基金管理人对外披露的任职日期填写;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,《融通深证成份指数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、法规的规定及基金合同的约定。

4.3 管理人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保证公平交易制度的严格执行。

本基金管理人报告期内不同时间窗口下0日内、3日内、5日内公司管理的不同投资组合间向交易的投资交易情况进行了分析,各投资组合的向间交易价差均处于合理范围之内。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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

4.4 管理人报告期内本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

本基金为被动式指数基金,原则上采用完全复制指数的投资策略,按照成份股在标的指数中的基准权重构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整,力争实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差小于0.35%,年化跟踪误差控制在4%的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2013上半年融通深证成份指数基金上涨下跌14.99%,同期业绩比较基准下跌14.81%。沪深300指数下跌12.78%,从各行业指数的表现来看:信息服务(百万)、电子(百万)和医药生物(百万)领涨,分别上涨32.58%、22.66%和18.81%,而采掘(百万)和有色金属(百万)领跌,分别下跌30.84%和29.82%。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济当前仍处于复苏中,国家统计局发布2013年1-5月全国规模以上工业企业利润数据显示,同比增长主要源于去年的基数。从与企业经营效果密切的主营活动利润变化看,工业企业盈利改善的幅度并不十分显著。从行业看,公用事业以及消费品制造业利润增速较高,是拉动利润回升的主力。当前经济虽然表现疲弱,但是下游消费需求尚可,例如汽车、地产、家电销量尚可,消费也相对稳健,而在转型压力下,产能压力较大的传统重化工业生存压力大,企业不出台刺激措施,去杠杆化以及结构性改革”的经济思路的大背景下,下半年的复苏之路将更加曲折。6月底的资金面持续紧张,表明了央行对流动性的加强,不再盲目的依赖扩大信贷总量来促进经济增长,促使更多资金流入实体经济

# 融通深证成份指数证券投资基金

## 【2013】半年度报告摘要

吴星华 朱建华 刘美丽  
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

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年度报告保持一致的说明  
本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况  
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项关联方

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按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未租用关联方的交易单元。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

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
当期发生的基金应支付的管理费	4,012,815.07	4,551,025.46
其中:支付销售机构的客户维护费	1,597,468.24	1,883,838.96

注:支付基金管理人融通基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值1.0%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日基金管理费=前一日基金资产净值×1.0%÷当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

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
当期发生的基金应支付的托管费	802,563.07	910,205.16

注:支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.2%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.2%÷当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易  
本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况  
本报告期末及上年度末,基金管理人主要股东及控制的机构均未持有本基金份额。

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方名称	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
中国工商银行	48,131,886.50	38,050,094.51
期末余额	164,526.42	52,313.03
当期利息收入	-	-

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况  
1.本基金本报告期及上年度可比期间均未买入管理人、托管人的控股股东在承销期内担任副主承销商或分销商所承销的证券;

2.本基金本报告期及上年度可比期间均未买入管理人、托管人的主要股东、非控股、在承销期内承销的证券。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项的说明。

6.4.5 期末2013年6月30日本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发及增发证券而于期末持有的流通受限证券  
本基金本报告期末未持有因认购新发及增发而流通受限的证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票  
本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易作为抵押的债券  
本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购  
本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购  
本基金本报告期末未持有因从交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	589,550,894.48	91.54
2	其中:股票	589,550,894.48	91.54
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	48,131,886.50	7.47
10	其他各项资产	6,350,910.77	0.99
11	合计	644,033,691.75	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	采矿业	23,386,954.73	3.64
C	制造业	332,006,595.72	51.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,588,030.22	1.80
F	批发和零售业	17,766,136.35	2.76
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	97,341,300.29	15.14
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	14,530,502.14	2.26
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计	-	584,101,602.91	90.87

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,449,291.57	0.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计	-	5,449,291.57	0.85

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000002	万科A	7,326,691	72,167,906.35	11.23
2	000051	格力电器	1,909,221	47,845,078.26	7.44
3	000001	平安银行	3,555,185	35,445,194.45	5.51
4	000858	五粮液	1,531,945	30,700,177.80	4.78
5	000727	广发证券	2,231,200	24,721,696.00	3.85
6	000526	美的电器	1,756,075	21,810,451.50	3.39
7	000895	双汇发展	539,748	20,247,913.12	3.23
8	000063	中兴通讯	1,570,454	20,023,288.50	3.11
9	000157	中联重科	3,667,181	19,912,792.83	3.10
10	000538	云南白药	236,828	19,895,929.28	3.10

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于基金管理人融通基金管理有限公司网站 http://www.rtfund.com 网站的半年度报告正文。

7.3.1 期末积极投资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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000625	长安汽车	199,929	1,857,340.41	0.29
2	000100	TCL集团	800,000	1,816,000.00	0.28
3	000725	京东方A	799,978	1,775,951.16	0.28

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

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	000776	广发电气	10,548,363.60	1.18
2	000024	招商地产	9,686,414.47	1.08
3	002415	海康威视	6,806,384.67	0.76
4	002081	金  融  街	4,623,947.35	0.52
5	002241	歌尔声学	2,212,889.88	0.25
6	000725	京东方A	1,896,254.86	0.21
7	000100	TCL集团	1,824,000.00	0.20
8	000625	长安汽车	1,727,667.88	0.19
9	000878	云南铜业	1,199,513.24	0.13
10	000758	中信股份	1,082,646.46	0.12
11	000423	泰禾集团	644,571.08	0.07
12	000157	中联重科	511,688.00	0.06
13	000538	云南白药	395,929.00	0.04
14	000709	河北钢铁	306,008.00	0.03
15	000858	五  粮  液	263,354.00	0.03
16	000425	徐工机械	247,491.00	0.03
17	000895	双汇发展	230,961.00	0.03
18	000792	盐湖股份	229,416.33	0.03
19	002024	苏宁云商	202,616.00	0.02
20	000663	中兴通讯	182,052.00	0.02

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额
----	------	------	----------