

融通深证成份指数证券投资基金

[2011] 第一季 度 报 告

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
报告送出日期:2011年4月22日

1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2011年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期自2011年1月1日起至3月31日止。

2 基金产品概况

基金名称:融通深证成份指数证券投资基金

交易代码:161612

前端交易代码:161610

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

报告期末基金份额总额:1,177,817,719.29份

本基金采取完全复制法进行指数化投资,通过严格的投资纪律和量化风险控制机制,力争使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,以实现对成份股的跟踪。

本基金为指数型基金,风险收益特征与股票型基金相似,其收益和风险水平高于股票型基金,但低于股票型基金和货币市场基金。

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

报告期(2011年1月1日-2011年3月31日)

1.本期已实现收益 23,788,852.36

2.本期利润 30,980,125.27

3.加权平均基金份额本期利润 0.0197

4.期末基金资产净值 1,195,828,769.03

5.期末基金份额净值 1.015

注:1)本期已实现收益指基金本期利润收入、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本报告所列示的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将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准③ 净值收益率④ 准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.59% 1.44% 0.83% 1.49% -0.24% -0.05%

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

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准③ 净值收益率④ 准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.59% 1.44% 0.83% 1.49% -0.24% -0.05%

注:1)本基金合同生效日为2010年11月15日。

②本基金的建仓期为自基金合同生效日起3个月。建仓期结束时,本基金各项资产配置比例符合基金合同的相关规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 说明

王建强 基金经理 2010年11月15日 -

本科学历,具有证券从业资格,2000年至2004年就职于上海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、基金经理助理职务。

李勇 基金经理 2010年11月15日 -

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、基金经理助理职务。

注:任职日期根据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的工作年限为准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《融通深证成份指数证券投资基金基金合同》及基金招募说明书的约定,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及基金合同的约定。

4.3 公平交易制度的执行情况

基金管理人一直坚持公平对待旗下所有基金的原则,并制定了相应的制度和流程,在投资决策和交易执行等各个环节保证公平交易原则的严格执行。报告期内,基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

4.3.2 投资组合与其它投资风格相似的基金组合之间的业绩比较

基金名称:融通深证成份指数证券投资基金

报告期(2011年1月1日-2011年3月31日)

1.本期已实现收益 -93,388,279.79

2.本期利润 -178,643,059.93

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0463

4.期末基金资产净值 3,622,315,508.88

5.期末基金份额净值 0.952

注:1)本期已实现收益指基金本期利润收入、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本报告所列示的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将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准③ 净值收益率④ 准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -4.49% 1.45% 2.67% 1.09% -7.16% 0.36%

3.2.2 自基金转型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

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准③ 净值收益率④ 准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -4.49% 1.45% 2.67% 1.09% -7.16% 0.36%

注:1)本基金转型日为2010年4月20日,从契约型开放式基金变更为契约型开放式基金(LOF)。

2)本基金转型日的基金份额净值为1.00元。

3)本基金转型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

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准③ 净值收益率④ 准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -4.49% 1.45% 2.67% 1.09% -7.16% 0.36%

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有基金的原则,并制定了相应的制度和流程,在投资决策和交易执行等各个环节保证公平交易原则的严格执行。报告期内,基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

4.3.2 投资组合与其它投资风格相似的基金组合之间的业绩比较

基金名称:融通深证成份指数证券投资基金

报告期(2011年1月1日-2011年3月31日)

1.本期已实现收益 -93,388,279.79

2.本期利润 -178,643,059.93

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0463

4.期末基金资产净值 3,622,315,508.88

5.期末基金份额净值 0.952

注:1)本期已实现收益指基金本期利润收入、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本报告所列示的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将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准③ 净值收益率④ 准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -4.49% 1.45% 2.67% 1.09% -7.16% 0.36%

3.2.2 自基金转型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

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准③ 净值收益率④ 准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -4.49% 1.45% 2.67% 1.09% -7.16% 0.36%

注:1)本基金转型日为2010年4月20日,从契约型开放式基金变更为契约型开放式基金(LOF)。

2)本基金转型日的基金份额净值为1.00元。

3)本基金转型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

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准③ 净值收益率④ 准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -4.49% 1.45% 2.67% 1.09% -7.16% 0.36%

4.3.3 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行为。

4.4 报告期内基金的利润分配情况

本基金报告期内未进行利润分配。

4.5 报告期内进行定期报告披露的情况

本基金报告期内披露了定期报告。

4.6 公平交易专项说明

4.6.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有基金的原则,并制定了相应的制度和流程,在投资决策和交易执行等各个环节保证公平交易原则的严格执行。报告期内,基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

4.6.2 投资组合与其它投资风格相似的基金组合之间的公平交易专项说明

基金名称:融通深证成份指数证券投资基金

报告期(2011年1月1日-2011年3月31日)

1.本期已实现收益 -93,388,279.79

2.本期利润 -178,643,059.93

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0463

4.期末基金资产净值 3,622,315,508.88

5.期末基金份额净值 0.952

注:1)本期已实现收益指基金本期利润收入、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本报告所列示的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将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准③ 净值收益率④ 准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -4.49% 1.45% 2.67% 1.09% -7.16% 0.36%

3.2.2 自基金转型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

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准③ 净值收益率④ 准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -4.49% 1.45% 2.67% 1.09% -7.16% 0.36%

注:1)本基金转型日为2010年4月20日,从契约型开放式基金变更为契约型开放式基金(LOF)。

2)本基金转型日的基金份额净值为1.00元。

3)本基金转型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

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准③ 净值收益率④ 准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -4.49% 1.45% 2.67% 1.09% -7.16% 0.36%

4.5 报告期内基金的利润分配情况

本基金报告期内未进行利润分配。

4.6 报告期内进行定期报告披露的情况