

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 2011 年半年度报告  
2011 年 6 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  
送出日期：2011 年 8 月 25 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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”）2011 年半年度报告。

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基金合同》规定，于 2011 年 8 月 23 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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>1</b>
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>4</b>
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	4
2.5 其他相关资料	5
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	5
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>6</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	7
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	7
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	7
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	7
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	8
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	8
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>8</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	8
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	8
5.3 托管人对半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	8
<b>§ 6 半年度财务报表(未经审计)</b>	<b>8</b>
6.1 资产负债表	8
6.2 利润表	10
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	10
6.4 报表附注	11
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>21</b>
7.1 期末基金资产组合情况	21
7.2 期末按行业分类的股票指数投资组合	21
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	22
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	24
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	26
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	26
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	26
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	26
7.9 投资组合报告附注	26
<b>§ 8 基金份额持有人信息</b>	<b>27</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	27
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	27
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b>	<b>27</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b>	<b>28</b>

10.1 基金份额持有人大会决议 .....	28
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	28
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	28
10.4 基金投资策略的改变 .....	28
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	28
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	28
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	28
10.8 其他重大事件 .....	29
<b>§ 11 备查文件目录 .....</b>	<b>29</b>

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	融通深证 100 指数证券投资基金	
基金简称	融通深证 100 指数	
基金主代码	161604	
交易代码	161604（前端收费模式）	161654（后端收费模式）
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	12,609,685,925.37 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化投资。股票指数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%
风险收益特征	风险和预期收益率接近市场平均水平

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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
信息披露 负责人	姓名	涂卫东	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
注册地址		深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518053	100140
法定代表人		田德军	姜建清

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	融通基金管理有限公司	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

## § 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(2011年1月1日至2011年6月30日)
本期已实现收益	113,477,647.53
本期利润	-730,060,853.07
加权平均基金份额本期利润	-0.0586
本期加权平均净值利润率	-4.50%
本期基金份额净值增长率	-4.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末可供分配利润	125,765,506.15
期末可供分配基金份额利润	0.0100
期末基金资产净值	15,967,883,075.69
期末基金份额净值	1.266
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011年6月30日)
基金份额累计净值增长率	274.03%

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

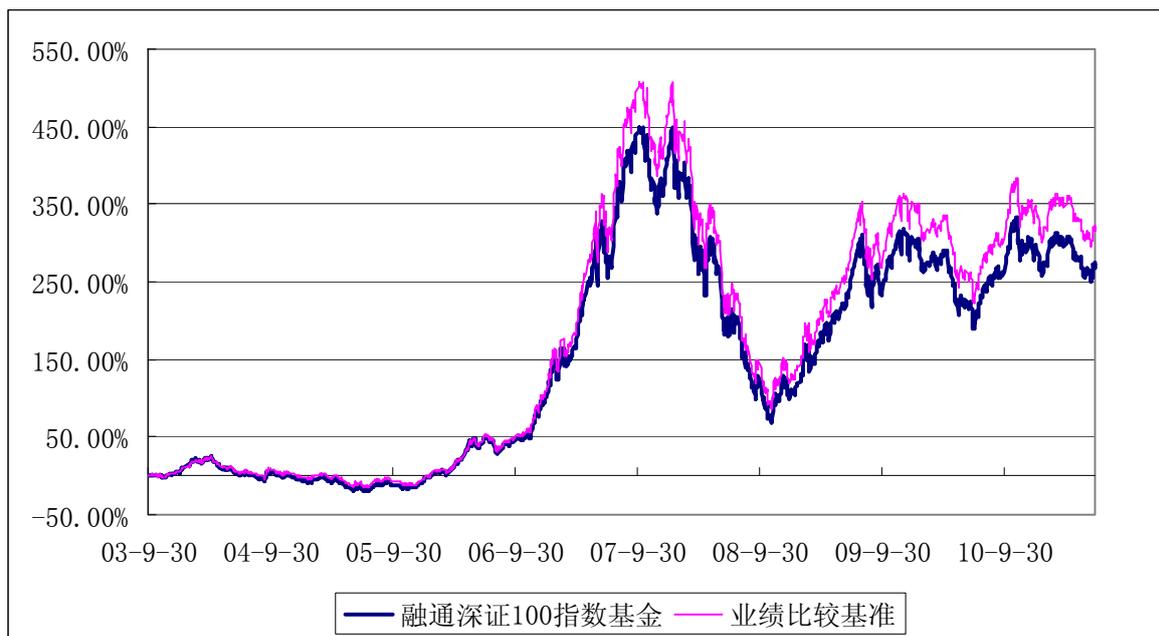
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	3.18%	1.25%	3.32%	1.24%	-0.14%	0.01%
过去三个月	-5.31%	1.15%	-4.94%	1.14%	-0.37%	0.01%
过去六个月	-4.66%	1.31%	-3.95%	1.31%	-0.71%	0.00%
过去一年	26.59%	1.49%	28.21%	1.48%	-1.62%	0.01%
过去三年	30.90%	1.97%	34.64%	1.98%	-3.74%	-0.01%
自基金合同生效起至今	274.03%	1.84%	322.88%	1.84%	-48.85%	0.00%

注：本报告中的基金业绩比较基准表现分段计算，其中：2005年8月21日（含此日）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为：新时代证券有限责任公司60%、日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co., Ltd.）40%。

截至2011年6月30日，公司管理的基金共有十二只：一只封闭式基金，即融通通乾封闭基金；十一只开放式基金，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和融通深证成份指数基金。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 基金经理小组简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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。	2009年5月15日	-	7	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、基金经理助理职务。
陶武彬	本基金的基金经理	2011年6月11日	-	14	硕士学位，具有证券从业资格。1997年7月至1998年4月，就职于中国化工建设深圳公司，从

					事外贸和投资工作，担任业务经理职务；1998 年 4 月至 1999 年 12 月，就职于深圳市深投投资有限公司，任财务顾问和投资银行项目经理职务；2000 年 1 月至 2001 年 1 月，就职于香港京华山一证券公司，任香港 IPO 和财务顾问高级经理职务；2001 年 1 月至今，就职于融通基金管理有限公司，历任行业研究员、基金经理、投资经理及部门副总监职务。
--	--	--	--	--	--

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，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

##### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人旗下没有与本基金投资风格相似的基金。

##### 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。

#### 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权重与深证 100 指数成份股自然权重的偏离，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-4.66%，业绩比较基准收益率为-3.95%。

#### 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，系统性大幅度下调的存在概率已经很小，但是由于实体经济和证券市场本身存在的许多结构性的问题制约着市场上涨的空间，我们认为 2011 年下半年并不存在系统性的大机会。从实体经济背景来看，目前仍然处于后金融危机时期，在这一阶段，金融危机阶段大超发的货币进入持续回收的阶段，金融危机前的全球化扩张模式进入持续的调整阶段，基本上很难期待国内外经济会出现超预期增长的情景。2010 年对于医药生物和电子信息行业出现一轮过热的期待之后，个人认为在一至两年之内都处于一个观察期：一方面观察新兴产业是否能真正带动经济结构出现转型成功的苗头；一方面观察政府在制度红利释放方面的诚意和力度。从投资结构的角度考虑，继续看好稳健增长的行业，从投资的时效性来考虑，负面因素较为集中的三季度中旬可能是选择指数基金投资较好的时机。

#### 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验，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，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前、事中及事后的审核工作。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

本基金管理人于 2011 年 1 月 12 日实施利润分配，以 2010 年 12 月 31 日的可分配收益为基准，每 10 份基金份额派发现金红利 0.13 元。

### § 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

2011 年上半年，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运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2011 年上半年，融通深证 100 指数证券投资基金的管理人——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 指数证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为 154,925,650.84 元。

#### 5.3 托管人对半年度报告中财务信息等内容的真实、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 2011 年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 半年度财务报表(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体：融通深证 100 指数证券投资基金

报告截止日：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
----	-----	------------------------	--------------------------

<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	309,706,383.07	384,755,788.50
结算备付金		3,548,931.43	-
存出保证金		3,809,565.75	2,086,481.71
交易性金融资产	6.4.7.2	15,623,999,098.82	15,575,183,272.91
其中：股票投资		15,093,391,098.82	15,138,721,272.91
基金投资		-	-
债券投资		530,608,000.00	436,462,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		46,551,089.12	-
应收利息	6.4.7.5	3,500,428.44	10,816,929.28
应收股利		-	-
应收申购款		23,184,186.02	60,582,027.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		16,014,299,682.65	16,033,424,500.31
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2011年6月30日</b>	<b>上年度末 2010年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	11,716,908.05
应付赎回款		25,783,790.78	14,506,242.18
应付管理人报酬		12,822,689.60	13,662,680.59
应付托管费		2,564,537.93	2,732,536.14
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,014,393.38	1,989,715.21
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	2,231,195.27	2,238,243.22
负债合计		46,416,606.96	46,846,325.39
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	12,609,685,925.37	11,923,403,026.51
未分配利润	6.4.7.10	3,358,197,150.32	4,063,175,148.41
所有者权益合计		15,967,883,075.69	15,986,578,174.92
负债和所有者权益总计		16,014,299,682.65	16,033,424,500.31

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.266 元，基金份额总额 12,609,685,925.37 份。

## 6.2 利润表

会计主体：融通深证 100 指数证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-625,466,715.47	-4,725,965,682.16
1. 利息收入		9,513,227.70	6,152,069.11
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,540,413.03	1,199,977.53
债券利息收入		7,972,814.67	4,905,888.30
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	46,203.28
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		207,161,612.43	29,278,428.89
其中：股票投资收益	6.4.7.12	133,698,631.76	-41,513,410.24
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-3,702,366.66	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	77,165,347.33	70,791,839.13
3. 公允价值变动收益	6.4.7.17	-843,538,500.60	-4,763,580,958.54
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	6.4.7.18	1,396,945.00	2,184,778.38
<b>二、费用</b>		104,594,137.60	96,493,616.78
1. 管理人报酬	6.4.10.2	80,414,232.04	77,337,420.52
2. 托管费	6.4.10.2	16,082,846.38	15,467,484.05
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	7,952,307.84	3,543,947.44
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	144,751.34	144,764.77
<b>三、利润总额</b>		-730,060,853.07	-4,822,459,298.94
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润</b>		-730,060,853.07	-4,822,459,298.94

## 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：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2011 年 1 月 1 日至 2011 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)	11,923,403,026.51	4,063,175,148.41	15,986,578,174.92
二、本期经营活动产生的基金净	-	-730,060,853.07	-730,060,853.07

值变动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	686,282,898.86	180,008,505.82	866,291,404.68
其中：1. 基金申购款	3,165,359,334.95	979,860,598.26	4,145,219,933.21
2. 基金赎回款	-2,479,076,436.09	-799,852,092.44	-3,278,928,528.53
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-154,925,650.84	-154,925,650.84
五、期末所有者权益（基金净值）	12,609,685,925.37	3,358,197,150.32	15,967,883,075.69
项目	上年度可比期间		
	2010 年 1 月 1 日至 2010 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）	12,394,223,828.39	4,863,880,588.40	17,258,104,416.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,822,459,298.94	-4,822,459,298.94
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	583,069,196.59	87,901,873.08	670,971,069.67
其中：1. 基金申购款	3,958,478,716.61	1,002,824,676.65	4,961,303,393.26
2. 基金赎回款	-3,375,409,520.02	-914,922,803.57	-4,290,332,323.59
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）	12,977,293,024.98	129,323,162.54	13,106,616,187.52

报表附注为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：

基金管理公司负责人：奚星华 主管会计工作负责人：奚星华 会计机构负责人：刘美丽

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

本基金是融通通利系列证券投资基金（以下简称“本系列基金”）之子基金，本系列基金经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2003]第 94 号《关于同意融通通利系列证券投资基金设立的批复》核准，由融通基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定（后由《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法规替代）和《融通通利系列证券投资基金基金契约》（后更名为《融通通利系列证券投资基金基金合同》）发起，并于 2003 年 9 月 30 日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，本基金首次设立，包括认购资金利息共募集人民币 477,689,377.16 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字（2003）第 138 号验资报告予以验证，其中认购资金为人民币 477,610,977.87 元，认购资金产生利息为人民币 78,399.29 元。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通通利系列证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为深证 100 指数成份股和债券，以基金非债券资产 90%以上的资金对深证 100 指数的成份股进行股票指数化投资，其中股票指数化投资部分不得低于基金资产的 50%，相对于深证 100 指数的日跟踪误差不超过 0.5%。此外本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的 80%；并保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金业绩比较基准为：深证 100 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38

项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《融通通利系列证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2011年6月30日的财务状况以及2011年1月1日至2011年6月30日期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 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年度报告一致。

#### 6.4.5 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。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1、以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- 2、基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- 3、对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。
- 4、基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
活期存款	309,706,383.07
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计：	309,706,383.07

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	13,904,529,759.23	15,093,391,098.82	1,188,861,339.59	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	531,355,133.34	530,608,000.00	-747,133.34
	合计	531,355,133.34	530,608,000.00	-747,133.34

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	14,435,884,892.57	15,623,999,098.82	1,188,114,206.25

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

**6.4.7.4 买入返售金融资产**

**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中所取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应收活期存款利息	43,771.30
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,437.30
应收债券利息	3,455,219.84
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	3,500,428.44

**6.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产余额。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
交易所市场应付交易费用	3,012,143.38
银行间市场应付交易费用	2,250.00
合计	3,014,393.38

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应付券商交易单元保证金	2,000,000.00
应付赎回费	92,805.95
预提费用	138,389.32
合计	2,231,195.27

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期

	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	11,923,403,026.51	11,923,403,026.51
本期申购	3,165,359,334.95	3,165,359,334.95
本期赎回(以“-”号填列)	-2,479,076,436.09	-2,479,076,436.09
本期末	12,609,685,925.37	12,609,685,925.37

注：本期申购含红利再投资和转换入份额，本期赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	164,305,412.33	3,898,869,736.08	4,063,175,148.41
本期利润	113,477,647.53	-843,538,500.60	-730,060,853.07
本期基金份额交易产生的变动数	2,908,097.13	177,100,408.69	180,008,505.82
其中：基金申购款	22,311,764.06	957,548,834.20	979,860,598.26
基金赎回款	-19,403,666.93	-780,448,425.51	-799,852,092.44
本期已分配利润	-154,925,650.84	-	-154,925,650.84
本期末	125,765,506.15	3,232,431,644.17	3,358,197,150.32

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,364,292.11
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	28,263.66
其他	147,857.26
合计	1,540,413.03

注：表中“其他”项目包括申购款利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,449,984,400.74
减：卖出股票成本总额	2,316,285,768.98
买卖股票差价收入	133,698,631.76

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
卖出债券及债券到期兑付成交总额	550,757,482.42
减：卖出债券及债券到期兑付成本总额	539,158,266.66
减：应收利息总额	15,301,582.42
债券投资收益	-3,702,366.66

#### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益/损失。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益/损失。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	77,165,347.33
基金投资产生的股利收益	-
合计	77,165,347.33

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
1. 交易性金融资产	-843,538,500.60
——股票投资	-846,206,067.26
——债券投资	2,667,566.66
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-843,538,500.60

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
基金赎回费收入	1,360,896.65
转换费分成	36,048.35
合计	1,396,945.00

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
交易所市场交易费用	7,949,407.84
银行间市场交易费用	2,900.00
合计	7,952,307.84

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
审计费用	84,300.75
信息披露费	49,588.57

银行费用	1,862.02
债券帐户维护费	9,000.00
合计	144,751.34

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**

**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要在财务报表中披露的重大或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至本财务报表批准日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方关系**

**6.4.9.1 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。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

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

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

**6.4.10.1 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。

**6.4.10.2 关联方报酬**

**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	80,414,232.04	77,337,420.52
其中：支付销售机构的客户维护费	9,951,065.12	9,679,498.24

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 1.00% 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 × 1.00% / 当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	16,082,846.38	15,467,484.05

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 0.20% 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 × 0.20% / 当年天数。

**6.4.10.3 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。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**

**6.4.10.4.1 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本基金管理人未投资于本基金。

**6.4.10.4.2 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其控制的机构未投资于本基金。

## 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	309,706,383.07	1,364,292.11	478,487,508.10	1,034,105.46

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。

## 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金本报告期和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、本基金本报告期和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）在承销期承销的股票。

## 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2011-1-12	2011-1-12	0.130	45,034,338.58	109,891,312.26	154,925,650.84	-
合计	-	-	0.130	45,034,338.58	109,891,312.26	154,925,650.84	-

## 6.4.12 期末（2011 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/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/增发证券而流通受限证券。

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000876	新希望	2011-6-29	重大资产重组	19.95	2011-7-5	21.95	4,581,201	43,338,867.35	91,394,959.95	-
000917	电广传媒	2010-1-27	重大资产重组	24.40	2011-7-6	26.84	3,685,406	61,318,047.84	89,923,906.40	-
000652	泰达股份	2010-1-22	重大事项	7.68	2011-7-8	7.68	10,772,790	129,202,073.34	82,735,027.20	-
000793	华闻传媒	2011-2-28	重大事项	5.66	2011-7-11	6.23	9,071,494	87,067,384.74	51,344,656.04	-

## 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

## 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末，本基金无交易所债券正回购交易中作为抵押的债券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

## 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本

基金的基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行建设全面风险管理体系、风控优先的政策，在董事会下设立风险控制与审计委员会，主要负责公司运行合规性的监督、核查以及公司内外部审计的沟通、监督和核查工作。委员会对董事会负责；在管理层层面设立风险控制委员会，负责建立健全公司的风险管理制度并组织实施，审定公司的业务风险管理政策，审定公司内控管理组织实施方案，审定公司的业务授权方案，审定基金资产组合的风险状况评价分析报告，审定公司各项风险与内控状况评价报告，审定业务风险损失责任人的责任，审定重大业务可行性风险论证，协调突发性重大风险事件的处理；各业务部门在执行业务事项时需遵守相关法律法规，遵守公司业务管理制度，具有根据业务特点控制业务风险的职责。业务人员是风险控制环节的直接责任人，部门负责人是控制业务风险管理的第一责任人，对部门风险控制措施的实施情况进行管理；风险管理小组由总经理办公会决定的投资专业人员和金融工程人员组成，负责制定相关业务风险的识别和度量方法，指导业务部门实施风险的管理和控制，并定期出具投资组合风险报告，进行投资风险分析与绩效评估；督察长和监察稽核部负责监察公司各业务部门在相关法律法规、规章制度和业务流程执行方面的情况，确保既定的风险控制措施得到有效的贯彻执行，发现内控缺失和管理漏洞，提出改进要求和建议，并报告法规和制度的执行情况。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2011 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2010 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证

券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	309,706,383.07	-	-	-	309,706,383.07
结算备付金	3,548,931.43	-	-	-	3,548,931.43
存出保证金	-	-	-	3,809,565.75	3,809,565.75
交易性金融资产	530,608,000.00	-	-	15,093,391,098.82	15,623,999,098.82
应收证券清算款	-	-	-	46,551,089.12	46,551,089.12
应收利息	-	-	-	3,500,428.44	3,500,428.44
应收申购款	8,923,865.04	-	-	14,260,320.98	23,184,186.02
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	852,787,179.54	-	-	15,161,512,503.11	16,014,299,682.65
负债					
应付赎回款	-	-	-	25,783,790.78	25,783,790.78
应付管理人报酬	-	-	-	12,822,689.60	12,822,689.60
应付托管费	-	-	-	2,564,537.93	2,564,537.93
应付交易费用	-	-	-	3,014,393.38	3,014,393.38
其他负债	-	-	-	2,231,195.27	2,231,195.27
负债总计	-	-	-	46,416,606.96	46,416,606.96
利率敏感度缺口	852,787,179.54	-	-	15,115,095,896.15	15,967,883,075.69
上年度末 2010年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	384,755,788.50	-	-	-	384,755,788.50
存出保证金	-	-	-	2,086,481.71	2,086,481.71
交易性金融资产	436,462,000.00	-	-	15,138,721,272.91	15,575,183,272.91
应收利息	-	-	-	10,816,929.28	10,816,929.28
应收申购款	26,045,600.93	-	-	34,536,426.98	60,582,027.91
资产总计	847,263,389.43	-	-	15,186,161,110.88	16,033,424,500.31
负债					
应付证券清算款	-	-	-	11,716,908.05	11,716,908.05
应付赎回款	-	-	-	14,506,242.18	14,506,242.18
应付管理人报酬	-	-	-	13,662,680.59	13,662,680.59
应付托管费	-	-	-	2,732,536.14	2,732,536.14
应付交易费用	-	-	-	1,989,715.21	1,989,715.21
其他负债	-	-	-	2,238,243.22	2,238,243.22
负债总计	-	-	-	46,846,325.39	46,846,325.39
利率敏感度缺口	847,263,389.43	-	-	15,139,314,785.49	15,986,578,174.92

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2011 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 3.32%（2010 年 12 月 31 日：2.73%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金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。金融工程小组负责对基金组合的跟踪误差和风险进行评估，定期提交组合跟踪误差和风险监控报告。在跟踪误差超过一定范围时，通知基金经理和相关部门，及时进行投资组合的调整。投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施。监察稽核部对投资的决策和执行过程进行日常监督。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票、债券的比例不低于本基金资产总值的 80%；并保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（Value at Risk）指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	15,093,391,098.82	94.52	15,138,721,272.91	94.70
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	530,608,000.00	3.32	436,462,000.00	2.73

衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	15,623,999,098.82	97.85	15,575,183,272.91	97.43

#### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

单位：人民币元

假设	除深证 100 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额	
		本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
	深证 100 指数上升 5%	758,474,446.10	759,362,463.31
	深证 100 指数下降 5%	-758,474,446.10	-759,362,463.31

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	15,093,391,098.82	94.25
	其中：股票	15,093,391,098.82	94.25
2	固定收益投资	530,608,000.00	3.31
	其中：债券	530,608,000.00	3.31
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	313,255,314.50	1.96
6	其他各项资产	77,045,269.33	0.48
7	合计	16,014,299,682.65	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票指数投资组合

#### 7.2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	57,517,419.60	0.36
B	采掘业	1,309,161,207.33	8.20
C	制造业	8,930,881,676.15	55.93
C0	食品、饮料	1,707,033,492.93	10.69
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	645,770,276.24	4.04
C5	电子	338,404,627.19	2.12

C6	金属、非金属	2,073,230,554.26	12.98
C7	机械、设备、仪表	3,203,705,211.29	20.06
C8	医药、生物制品	854,805,223.13	5.35
C99	其他制造业	107,932,291.11	0.68
D	电力、煤气及水的生产和供应业	161,478,410.06	1.01
E	建筑业	54,259,909.80	0.34
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	475,189,096.08	2.98
H	批发和零售贸易	688,386,932.38	4.31
I	金融、保险业	1,281,165,570.74	8.02
J	房地产业	1,280,762,957.19	8.02
K	社会服务业	200,940,506.41	1.26
L	传播与文化产业	141,268,562.44	0.88
M	综合类	512,378,850.64	3.21
	合计	15,093,391,098.82	94.52

### 7.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

### 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	87,231,358	737,104,975.10	4.62
2	000858	五粮液	17,981,356	642,294,036.32	4.02
3	002024	苏宁电器	43,356,418	555,395,714.58	3.48
4	000651	格力电器	20,620,025	484,570,587.50	3.03
5	000157	中联重科	29,802,287	458,359,174.06	2.87
6	000001	深发展A	26,461,652	451,700,399.64	2.83
7	000063	中兴通讯	15,036,522	425,232,842.16	2.66
8	000983	西山煤电	15,519,423	375,570,036.60	2.35
9	000527	美的电器	18,620,659	342,433,919.01	2.14
10	000338	潍柴动力	7,266,762	330,128,997.66	2.07
11	000568	泸州老窖	6,977,641	314,831,161.92	1.97
12	000776	广发证券	7,749,458	304,166,226.50	1.90
13	000792	盐湖股份	4,921,626	290,375,934.00	1.82
14	000629	攀钢钒钛	23,999,493	265,674,387.51	1.66
15	000423	东阿阿胶	5,416,446	223,482,561.96	1.40
16	000895	双汇发展	3,183,615	210,341,443.05	1.32
17	000039	中集集团	9,247,735	202,340,441.80	1.27
18	002304	洋河股份	1,599,695	201,817,521.20	1.26
19	000069	华侨城A	25,403,351	200,940,506.41	1.26
20	000937	冀中能源	7,862,116	199,304,640.60	1.25
21	002202	金风科技	13,143,097	196,226,438.21	1.23

22	000425	徐工机械	7,615,225	188,781,427.75	1.18
23	000012	南玻A	11,233,755	185,356,957.50	1.16
24	000009	中国宝安	10,499,024	180,793,193.28	1.13
25	000060	中金岭南	13,541,449	180,101,271.70	1.13
26	000402	金融街	23,996,859	179,256,536.73	1.12
27	000401	冀东水泥	7,158,673	178,895,238.27	1.12
28	000709	河北钢铁	39,509,088	178,581,077.76	1.12
29	000630	铜陵有色	7,402,660	178,404,106.00	1.12
30	000623	吉林敖东	5,656,658	174,281,632.98	1.09
31	000538	云南白药	3,020,613	172,416,590.04	1.08
32	000783	长江证券	15,833,069	170,522,153.13	1.07
33	000100	TCL集团	52,102,341	155,785,999.59	0.98
34	000024	招商地产	8,082,942	147,917,838.60	0.93
35	000528	柳工	6,394,921	144,717,062.23	0.91
36	000758	中色股份	4,065,442	143,713,374.70	0.90
37	000933	神火股份	9,357,677	142,330,267.17	0.89
38	000960	锡业股份	4,852,007	141,193,403.70	0.88
39	000878	云南铜业	6,209,136	136,042,169.76	0.85
40	002106	莱宝高科	4,263,194	128,961,618.50	0.81
41	000768	西飞国际	11,520,830	126,844,338.30	0.79
42	002142	宁波银行	11,506,520	125,190,937.60	0.78
43	002155	辰州矿业	3,715,882	121,472,182.58	0.76
44	000800	一汽轿车	8,265,378	117,037,752.48	0.73
45	000680	山推股份	6,513,685	114,575,719.15	0.72
46	000825	太钢不锈	21,986,476	113,230,351.40	0.71
47	002007	华兰生物	3,325,358	112,862,650.52	0.71
48	000778	新兴铸管	10,464,424	110,399,673.20	0.69
49	000969	安泰科技	5,526,487	107,932,291.11	0.68
50	000581	威孚高科	2,749,599	105,997,041.45	0.66
51	000839	中信国安	10,099,318	105,133,900.38	0.66
52	000422	湖北宜化	4,886,664	102,277,877.52	0.64
53	002008	大族激光	7,868,855	98,203,310.40	0.62
54	000728	国元证券	8,518,804	96,262,485.20	0.60
55	000898	鞍钢股份	13,849,414	94,176,015.20	0.59
56	000729	燕京啤酒	5,475,858	92,925,310.26	0.58
57	000876	新希望	4,581,201	91,394,959.95	0.57
58	000562	宏源证券	5,385,837	89,997,336.27	0.56
59	000917	电广传媒	3,685,406	89,923,906.40	0.56
60	002001	新和成	3,031,366	89,273,728.70	0.56
61	000869	张裕A	900,941	89,012,970.80	0.56
62	000059	辽通化工	6,362,727	86,405,832.66	0.54
63	000400	许继电气	2,726,332	83,998,288.92	0.53

64	000061	农产品	5,226,979	83,422,584.84	0.52
65	000625	长安汽车	9,083,956	83,118,197.40	0.52
66	000652	泰达股份	10,772,790	82,735,027.20	0.52
67	000968	煤气化	3,159,675	80,034,567.75	0.50
68	000762	西藏矿业	2,370,204	78,643,368.72	0.49
69	002092	中泰化学	5,902,203	77,436,903.36	0.48
70	000540	中天城投	4,599,775	76,632,251.50	0.48
71	000541	佛山照明	5,524,155	74,907,541.80	0.47
72	002122	天马股份	5,672,805	72,611,904.00	0.45
73	000999	华润三九	3,894,957	69,914,478.15	0.44
74	000559	万向钱潮	8,362,429	67,233,929.16	0.42
75	000503	海虹控股	7,323,633	67,084,478.28	0.42
76	002128	露天煤业	3,083,722	67,070,953.50	0.42
77	000930	中粮生化	8,290,359	64,416,089.43	0.40
78	000690	宝新能源	12,660,323	63,554,821.46	0.40
79	000897	津滨发展	13,639,312	62,195,262.72	0.39
80	000612	焦作万方	3,407,363	60,787,355.92	0.38
81	000027	深圳能源	7,739,580	58,356,433.20	0.37
82	002069	獐子岛	2,366,972	57,517,419.60	0.36
83	000031	中粮地产	9,678,397	55,360,430.84	0.35
84	002022	科华生物	4,136,627	54,768,941.48	0.34
85	002081	金螳螂	1,349,749	54,259,909.80	0.34
86	002056	横店东磁	1,954,718	53,657,009.10	0.34
87	000718	苏宁环球	6,544,331	52,354,648.00	0.33
88	000655	金岭矿业	2,707,301	51,736,522.11	0.32
89	000793	华闻传媒	9,071,494	51,344,656.04	0.32
90	000021	长城开发	6,033,364	49,956,253.92	0.31
91	000829	天音控股	5,423,264	49,568,632.96	0.31
92	000780	平庄能源	3,099,704	49,285,293.60	0.31
93	000786	北新建材	3,019,994	48,048,104.54	0.30
94	000522	白云山 A	3,246,784	47,078,368.00	0.29
95	002146	荣盛发展	4,752,374	46,573,265.20	0.29
96	000550	江铃汽车	1,749,274	45,953,427.98	0.29
97	000686	东北证券	2,155,524	43,326,032.40	0.27
98	000539	粤电力 A	7,327,251	39,567,155.40	0.25
99	002028	思源电气	2,872,325	39,322,129.25	0.25
100	000927	一汽夏利	4,062,893	28,684,024.58	0.18

### 7.3.2 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所有股票投资明细

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

### 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 名的股票投资明细

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	000776	广发证券	298,671,864.73	1.87
2	000629	攀钢钒钛	267,164,050.58	1.67
3	002304	洋河股份	197,312,547.67	1.23
4	000157	中联重科	116,425,967.46	0.73
5	000581	威孚高科	105,072,204.77	0.66
6	000783	长江证券	94,705,872.47	0.59
7	002202	金风科技	85,322,292.78	0.53
8	000792	盐湖股份	80,783,744.55	0.51
9	000540	中天城投	77,538,877.01	0.49
10	000002	万科A	74,517,506.28	0.47
11	002024	苏宁电器	70,950,219.26	0.44
12	002106	莱宝高科	66,306,264.13	0.41
13	000630	铜陵有色	61,871,492.59	0.39
14	000012	南玻A	61,360,251.77	0.38
15	002081	金螳螂	53,377,080.68	0.33
16	000625	长安汽车	51,351,608.49	0.32
17	000780	平庄能源	48,859,102.45	0.31
18	000858	五粮液	47,232,242.77	0.30
19	000651	格力电器	46,290,672.87	0.29
20	002146	荣盛发展	46,171,858.12	0.29

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，相关交易费用不考虑。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000002	万科A	126,016,169.60	0.79
2	000858	五粮液	89,993,958.50	0.56
3	002024	苏宁电器	82,522,904.86	0.52
4	000651	格力电器	77,278,589.63	0.48
5	000012	南玻A	72,111,660.97	0.45
6	000488	晨鸣纸业	68,916,409.49	0.43
7	000338	潍柴动力	66,143,731.00	0.41
8	000001	深发展A	61,413,930.68	0.38
9	000667	名流置业	61,230,754.26	0.38
10	000527	美的电器	59,393,004.45	0.37
11	000983	西山煤电	55,941,742.47	0.35
12	000792	盐湖股份	55,380,269.51	0.35
13	000783	长江证券	54,120,432.92	0.34
14	000060	中金岭南	53,754,305.99	0.34
15	000063	中兴通讯	51,718,024.07	0.32
16	000568	泸州老窖	51,712,495.78	0.32
17	000900	现代投资	49,384,847.46	0.31

18	000066	长城电脑	49,263,877.07	0.31
19	002202	金风科技	48,542,453.58	0.30
20	002078	太阳纸业	41,601,812.46	0.26

注：“卖出金额”是指卖出股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,117,161,662.15
卖出股票收入（成交）总额	2,449,984,400.74

注：表中“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均指成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	530,608,000.00	3.32
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	530,608,000.00	3.32

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1101023	11 央行票据 23	2,000,000	198,500,000.00	1.24
2	1101016	11 央行票据 16	2,000,000	193,200,000.00	1.21
3	1101031	11 央行票据 31	1,400,000	138,908,000.00	0.87

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.9 投资组合报告附注

##### 7.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形：

2011 年 5 月 27 日，五粮液收到中国证监会的《行政处罚决定书》。本基金投资该股票的决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

报告期内，基金投资的前十名证券中其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

##### 7.9.2 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

##### 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	3,809,565.75
2	应收证券清算款	46,551,089.12
3	应收股利	-
4	应收利息	3,500,428.44
5	应收申购款	23,184,186.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	77,045,269.33

#### 7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.9.5 期末股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.9.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资部分前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 7.9.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
1,014,059	12,434.86	402,354,139.42	3.19%	12,207,331,785.95	96.81%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	3,231,153.09	0.0256%

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2003年9月30日)基金份额总额	477,689,377.16
本报告期期初基金份额总额	11,923,403,026.51
本报告期基金总申购份额	3,165,359,334.95
减:本报告期基金总赎回份额	2,479,076,436.09
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	12,609,685,925.37

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期末未召开基金份额持有人大会

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 基金管理人的重大变动

1、经公司董事会审议并经中国证监会核准，奚星华先生担任公司总经理职务，颜锡廉先生（Allen Yan）担任公司副总经理职务，涂卫东先生担任公司督察长职务。经公司董事会审议并报中国证监会备案，吴冶平先生辞去公司督察长职务。

具体内容请参阅 2011 年 3 月 26 日在《证券时报》上刊登的相关公告。

2、自 2011 年 6 月 11 日起，增聘陶武彬先生担任本基金的基金经理，与王建强先生共同管理本基金。

具体内容请参阅 2011 年 6 月 11 日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上刊登的相关公告。

10.2.2 本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

在本报告期内没有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金的投资策略未发生变更。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所，仍为普华永道中天会计师事务所有限公司。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情形。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	1,472,202,401.82	26.77%	1,196,175.34	26.77%	-
长城证券	1	1,116,166,775.18	20.30%	906,891.47	20.30%	-
海通证券	1	910,280,319.18	16.55%	739,608.71	16.55%	-
华泰联合证券	1	656,415,976.28	11.94%	533,340.50	11.94%	-
长江证券	1	528,462,709.84	9.61%	429,379.08	9.61%	-
中金公司	1	417,983,537.27	7.60%	339,614.18	7.60%	-
平安证券	1	327,803,613.45	5.96%	266,342.33	5.96%	-
中信证券	1	70,001,693.12	1.27%	56,877.05	1.27%	-
中信万通	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的标准包括以下六个方面：

- (1) 资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；

- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

2、选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的程序包括以下四个步骤：

- (1) 券商服务评价；
  - (2) 拟定租用对象。由研究部根据以上评价结果拟定备选的券商；
  - (3) 上报批准。研究部将拟定租用对象上报分管副总经理批准；
  - (4) 签约。在获得批准后，按公司签约程序代表公司与确定券商签约。
- 3、本报告期内基金租用交易单元无变更。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

#### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	融通金算盘家族之融通深证 100 指数证券投资基金分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011-1-7
2	融通基金管理有限公司关于公司旗下基金所持有的盐湖钾肥估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011-3-1
3	融通基金管理有限公司高级管理人员任职公告	证券时报、管理人网站	2011-3-26
4	融通基金管理有限公司关于公司旗下基金所持有的盐湖钾肥恢复采用收盘价估值的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011-3-29
5	融通基金管理有限公司关于新增恒泰长财证券有限责任公司代理融通旗下开放式基金销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011-5-16
6	融通深证 100 指数证券投资基金基金经理增聘公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011-6-11

#### § 11 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准融通通利系列证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通通利系列证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通通利系列证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通通利系列证券投资基金招募说明书》及其定期更新
- (五) 《融通基金管理有限公司开放式基金业务管理规则》
- (六) 融通基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- (七) 基金托管人中国工商银行业务资格批件和营业执照

存放地点：基金管理人、基金托管人处。

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件，或登录本基金管理人网站 <http://www.rtfund.com> 查阅。