

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 年第 4 季度报告  
2011 年 12 月 31 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  
报告送出日期：2012 年 1 月 19 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 年第 4 季度报告。

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《融通通利系列证券投资基金基金合同》规定，于 2012 年 1 月 17 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 10 月 1 日起至 2011 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	融通深证 100 指数
交易代码	161604
前端交易代码	161604
后端交易代码	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
报告期末基金份额总额	13,719,041,075.95 份
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 $\times$ 95% + 银行同业存款利率 $\times$ 5%
风险收益特征	风险和预期收益率接近市场平均水平
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

主要财务指标	报告期（2011 年 10 月 1 日 — 2011 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	-293,117,191.02
2. 本期利润	-1,951,711,160.40
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1424

4. 期末基金资产净值	12,807,082,759.36
5. 期末基金份额净值	0.934

注：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；

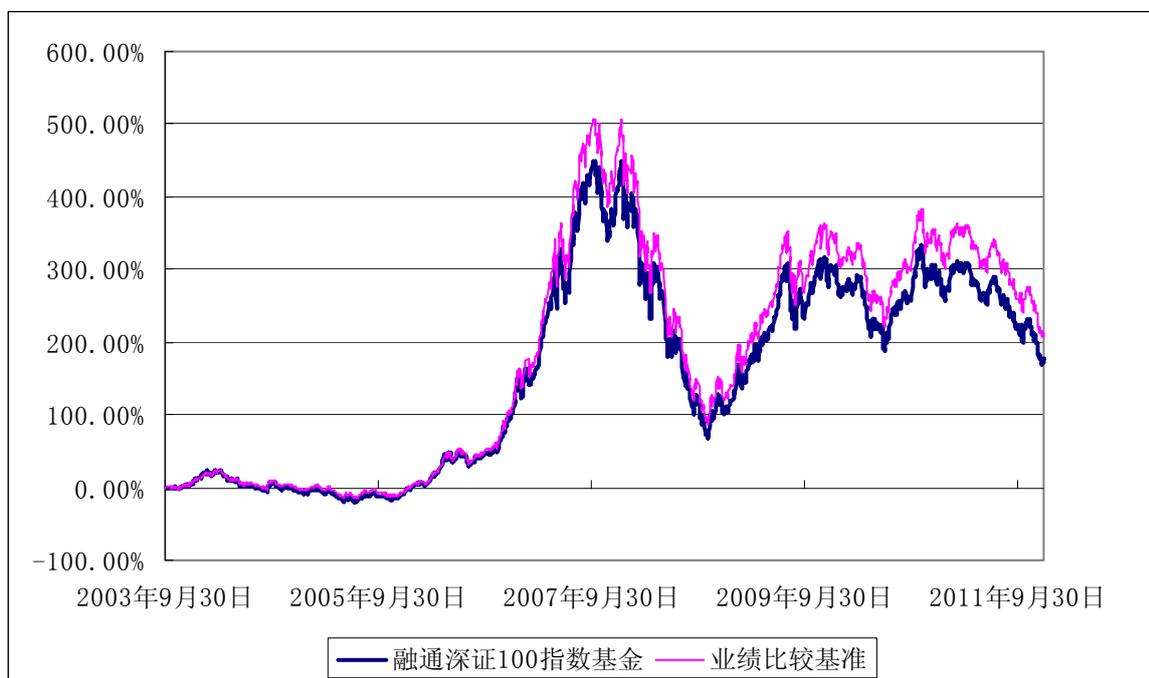
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 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	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-13.04%	1.46%	-12.99%	1.46%	-0.05%	0.00%

#### 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



注：上表中基金业绩比较基准项目分段计算，其中：2005 年 8 月 21 日之前(含此日)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%”。

## § 4 管理人报告

### 4.1 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	2009 年 5 月 15 日	-	8	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。

	金经理。				
陶武彬	本基金的基金经理	2011 年 6 月 11 日	2011 年 12 月 8 日	15	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：任职日期和离任日期均指根据基金管理人对外披露的任免日期填写；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 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，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 报告期内基金的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。

2011 年第四季度深证 100 指数下跌 13.66%。从各行业类指数的表现来看：金融服务跌-1.56%，在 23 个申万一级行业指数跌幅最少，而有色金属下跌 23.15%，跌幅最大。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为-13.04%，同期业绩比较基准收益率为-12.99%。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	12,143,273,323.07	94.06

	其中：股票	12,143,273,323.07	94.06
2	固定收益投资	624,618,000.00	4.84
	其中：债券	624,618,000.00	4.84
	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	111,726,259.23	0.87
6	其他资产	30,048,119.22	0.23
7	合计	12,909,665,701.52	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末指数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、渔业	61,313,254.08	0.48
B	采掘业	869,627,164.55	6.79
C	制造业	7,248,707,198.71	56.60
C0	食品、饮料	1,727,654,844.69	13.49
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	397,474,572.97	3.10
C5	电子	323,321,887.68	2.52
C6	金属、非金属	1,570,926,941.72	12.27
C7	机械、设备、仪表	2,494,151,027.99	19.47
C8	医药、生物制品	735,177,923.66	5.74
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	90,677,577.64	0.71
E	建筑业	65,239,564.30	0.51
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	371,202,281.69	2.90
H	批发和零售贸易	496,324,000.52	3.88
I	金融、保险业	1,038,376,196.94	8.11
J	房地产业	1,203,082,969.85	9.39
K	社会服务业	207,066,790.14	1.62
L	传播与文化产业	145,138,948.36	1.13
M	综合类	346,517,376.29	2.71
	合计	12,143,273,323.07	94.82

### 5.2.2 报告期末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。

## 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000002	万科A	93,990,303	702,107,563.41	5.48
2	000858	五粮液	20,203,823	662,685,394.40	5.17

3	000001	深发展 A	28,290,945	441,055,832.55	3.44
4	002024	苏宁电器	46,836,047	395,296,236.68	3.09
5	000651	格力电器	22,571,423	390,259,903.67	3.05
6	000157	中联重科	44,042,855	338,689,554.95	2.64
7	000063	中兴通讯	20,007,524	338,127,155.60	2.64
8	000568	泸州老窖	7,563,663	282,124,629.90	2.20
9	000423	东阿阿胶	5,851,109	251,305,131.55	1.96
10	000338	潍柴动力	7,977,341	251,286,241.50	1.96

### 5.3.2 报告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

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	50,205,000.00	0.39
2	央行票据	193,280,000.00	1.51
3	金融债券	381,133,000.00	2.98
	其中：政策性金融债	381,133,000.00	2.98
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	624,618,000.00	4.88

### 5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110414	11 农发 14	3,300,000	331,023,000.00	2.58
2	1101094	11 央行票据 94	1,000,000	96,640,000.00	0.75
3	1101096	11 央行票据 96	1,000,000	96,640,000.00	0.75
4	110018	11 付息国债 18	500,000	50,205,000.00	0.39
5	110242	11 国开 42	500,000	50,110,000.00	0.39

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

### 5.7 报告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。

### 5.8 投资组合报告附注

#### 5.8.1 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。

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

#### 5.8.2 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。

#### 5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,531,902.51

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,200,101.19
5	应收申购款	19,316,115.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,048,119.22

#### 5.8.4 报告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。

#### 5.8.5 报告期末股票中存在流通受限情况的说明

##### 5.8.5.1 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。

##### 5.8.5.2 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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	13,357,372,374.25
本报告期基金总申购份额	1,275,768,141.48
减：本报告期基金总赎回份额	914,099,439.78
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	13,719,041,075.95

## § 7 备查文件目录

### 7.1 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》及其更新
- (五) 融通基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- (六) 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

### 7.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 7.3 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，或登陆本基金管理人网站 [www.rtfund.com](http://www.rtfund.com) 查询。

融通基金管理有限公司  
二〇一二年一月十九日