

# 融通深证成份指数证券投资基金 2012 年半年度报告摘要

2012 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： 2012 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示

### 1.1 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深证成份指数证券投资基金基金合同规定，于 2012 年 8 月 20 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 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           |                |
| 基金主代码      | 161612             |                |
| 交易代码       | 161612（前端收费模式）     | 161662（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    | 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 | 1,215,486,933.76 份 |                |
| 基金合同存续期    | 不定期                |                |

### 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，以实现深证成份指数的有效跟踪。 |
| 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                                                                 |

|        |                                                                                            |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | 建指数化投资组合，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、<br>(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 | <a href="http://www.rtfund.com">http://www.rtfund.com</a> |
| 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(2012 年 1 月 1 日 - 2012 年 6 月 30 日) |
|---------------|---------------------------------------|
| 本期已实现收益       | -18,212,741.74                        |
| 本期利润          | 42,416,605.56                         |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0369                                |
| 本期基金份额净值增长率   | 6.29%                                 |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2012 年 6 月 30 日)                 |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.2231                               |
| 期末基金资产净值      | 944,364,416.67                        |
| 期末基金份额净值      | 0.777                                 |

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

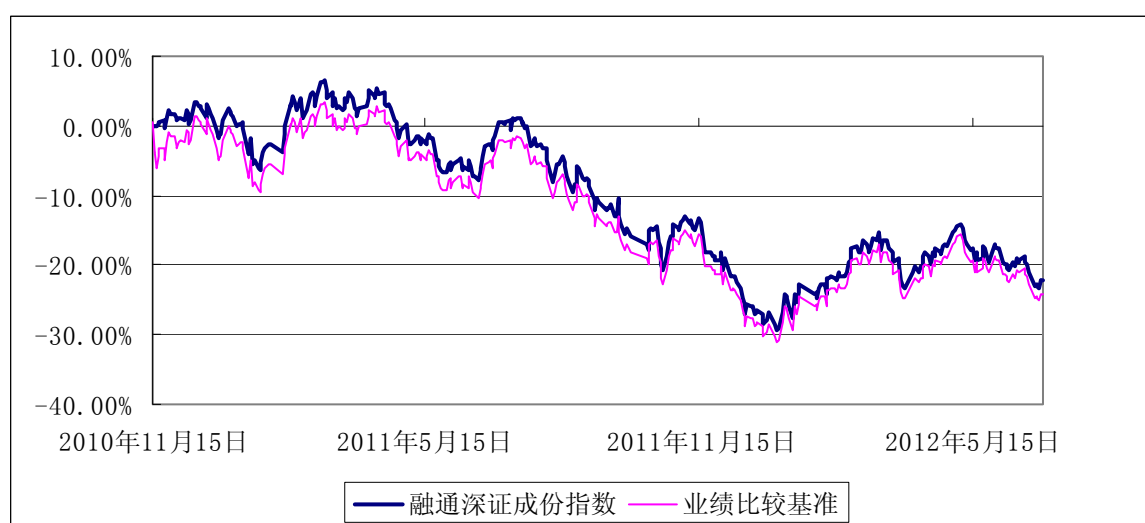
配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

## 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      | -5.82%   | 1.08%       | -6.01%     | 1.08%         | 0.19%  | 0.00%  |
| 过去三个月      | 1.17%    | 1.21%       | 0.94%      | 1.21%         | 0.23%  | 0.00%  |
| 过去六个月      | 6.29%    | 1.39%       | 6.26%      | 1.40%         | 0.03%  | -0.01% |
| 过去一年       | -20.71%  | 1.36%       | -20.48%    | 1.36%         | -0.23% | 0.00%  |
| 自基金合同生效起至今 | -22.30%  | 1.30%       | -24.07%    | 1.37%         | 1.77%  | -0.07% |

### 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2012年6月30日，公司管理的基金共有十四只，一只封闭式基金，即融通通乾封闭基金，十三只开放式基金，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、融通深证成份指数基金、融通四季添利债券基金和融通创业板指数基金。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（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务                                                             | 任本基金的基金经理（助理）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 | -    | 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。 |
| 李勇  | 本基金的基金经理、融通创业板指数基金基金经理                                         | 2010 年 11 月 15 日 | -    | 7      | 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合规守信情况的说明

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投资组合的原则，并制定了相应的制度和流程，在授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。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 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

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指数化投资组合，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平均跟踪误差小于 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

报告期内本基金份额净值增长率为 6.29%，同期业绩比较基准收益率为 6.26%。从各行业指数的表现来看：房地产(申万)、有色金属(申万)和食品饮料(申万)领涨，分别上涨 21.81%、18.2%和 15.03%，而信息服务(申万)和黑色金属(申万)领跌，分别下跌 7.64%和 4.52%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2012 下半年证券市场的表现，通货膨胀已进入下降通道，并有加速回落的趋势，而随着 6 月初央行首次下调利率，货币政策放松的趋势更加明显，下半年政策的核心将逐步由控通胀转为“稳增长”，可见，宏观经济正逐步进入衰退后期，从投资时钟的角度看，是有利于股票市场的。从股票市场看，今年一季度 A 股净利润增速呈现见底回升的迹象。2011 年四季度和 2012 年一季度的单季度净利润同比增长分别为-6.73 %和 0.99%，扣除银行和保险分别为-18.06%和-13.81%。展望下半年，由于收入缓慢恢复以及去年下半年的低基数效应，A 股上市公司的净利润增速将缓慢恢复，由利润大幅下滑带来的盈利和估值的双杀有望反转。目前 A 股市场的估值为 14 倍，动态估值为 10 倍，处于历史最低点。且从各个市场的收益率对比来看，随着市场利率的下降，股票市场已具备吸引力。总体来看，下半年 A 股市场仍有望维持震荡上行的趋势。在行业配置上，从一轮周期来看，除非经济趋势已经确定看好，否则之前的板块具有强者恒强的特征。医药、白酒、券商、保险、地产等资产有望在下半年仍有较好表现。此外，经济转型的实质是产业之间盈利的重新分配，将盈利能力从传统经济增长动力的领域转向推动转型的经济增长领域，因而相关的产业如消费服务和政策支持的节能环保等新型公共投资也值得关注。

## 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、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

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关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

2012 年上半年，本基金托管人在对融通深证成份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

2012 年上半年，融通深证成份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成份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，融通深证成份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成份指数证券投资基金 2012 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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：融通深证成份指数证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产             | 本期末<br>2012 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2011 年 12 月 31 日         |
|-----------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |                                |                                  |
| 银行存款            | 38,050,094.51                  | 1,061,566.89                     |
| 结算备付金           | 1,250,923.74                   | 17,238.57                        |
| 存出保证金           | 508,404.26                     | 473,029.64                       |
| 交易性金融资产         | 906,083,923.06                 | 808,638,023.85                   |
| 其中：股票投资         | 886,713,923.06                 | 768,912,023.85                   |
| 基金投资            | -                              | -                                |
| 债券投资            | 19,370,000.00                  | 39,726,000.00                    |
| 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         | -                              | 661,371.37                       |
| 应收利息            | 449,492.47                     | 611,977.29                       |
| 应收股利            | -                              | -                                |
| 应收申购款           | 472,144.70                     | 406,610.29                       |
| 递延所得税资产         | -                              | -                                |
| 其他资产            | -                              | -                                |
| 资产总计            | 946,814,982.74                 | 811,869,817.90                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2012 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2011 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          | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       | -                              | -                                |
| 应付证券清算款         | -                              | -                                |
| 应付赎回款           | 1,124,338.37                   | 443,212.53                       |
| 应付管理人报酬         | 802,795.49                     | 714,060.99                       |
| 应付托管费           | 160,559.10                     | 142,812.19                       |
| 应付销售服务费         | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 156,914.45                     | 48,122.22                        |
| 应交税费            | -                              | -                                |

|               |                  |                  |
|---------------|------------------|------------------|
| 应付利息          | -                | -                |
| 应付利润          | -                | -                |
| 递延所得税负债       | -                | -                |
| 其他负债          | 205,958.66       | 105,551.20       |
| 负债合计          | 2,450,566.07     | 1,453,759.13     |
| <b>所有者权益：</b> |                  |                  |
| 实收基金          | 1,215,486,933.76 | 1,107,985,877.46 |
| 未分配利润         | -271,122,517.09  | -297,569,818.69  |
| 所有者权益合计       | 944,364,416.67   | 810,416,058.77   |
| 负债和所有者权益总计    | 946,814,982.74   | 811,869,817.90   |

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.777 元，基金份额总额 1,215,486,933.76 份。

## 6.2 利润表

会计主体：融通深证成份指数证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目         | 本期<br>2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6<br>月 30 日 |
|-------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、收入</b> | 48,396,136.25                            | 7,727,960.45                                  |
| 1. 利息收入     | 724,362.88                               | 649,983.81                                    |
| 其中：存款利息收入   | 61,374.13                                | 257,956.41                                    |
| 债券利息收入      | 662,988.75                               | 392,027.40                                    |
| 资产支持证券利息收入  | -                                        | -                                             |
| 买入返售金融资产收入  | -                                        | -                                             |
| 其他利息收入      | -                                        | -                                             |
| 2. 投资收益     | -13,056,483.49                           | 35,484,510.48                                 |
| 其中：股票投资收益   | -18,251,123.98                           | 30,605,659.03                                 |
| 基金投资收益      | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益      | -29,020.00                               | 247,650.00                                    |
| 资产支持证券投资收益  | -                                        | -                                             |
| 衍生工具收益      | -                                        | -                                             |
| 股利收益        | 5,223,660.49                             | 4,631,201.45                                  |
| 3. 公允价值变动收益 | 60,629,347.30                            | -29,575,052.61                                |
| 4. 汇兑收益     | -                                        | -                                             |
| 5. 其他收入     | 98,909.56                                | 1,168,518.77                                  |
| <b>二、费用</b> | 5,979,530.69                             | 10,247,019.64                                 |
| 1. 管理人报酬    | 4,551,025.46                             | 6,647,374.83                                  |
| 2. 托管费      | 910,205.16                               | 1,329,474.92                                  |
| 3. 销售服务费    | -                                        | -                                             |
| 4. 交易费用     | 309,946.91                               | 2,061,034.11                                  |

|               |                      |                      |
|---------------|----------------------|----------------------|
| 5. 利息支出       | -                    | -                    |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | -                    | -                    |
| 6. 其他费用       | 208,353.16           | 209,135.78           |
| <b>三、利润总额</b> | <b>42,416,605.56</b> | <b>-2,519,059.19</b> |
| 减：所得税费用       | -                    | -                    |
| <b>四、净利润</b>  | <b>42,416,605.56</b> | <b>-2,519,059.19</b> |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通深证成份指数证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                        | 本期<br>2012 年 1 月 1 日至 2012 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）           | 1,107,985,877.46                           | -297,569,818.69 | 810,416,058.77   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）  | -                                          | 42,416,605.56   | 42,416,605.56    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数      | 107,501,056.30                             | -15,969,303.96  | 91,531,752.34    |
| 其中：1.基金申购款                | 221,911,590.53                             | -38,121,405.84  | 183,790,184.69   |
| 2.基金赎回款                   | -114,410,534.23                            | 22,152,101.88   | -92,258,432.35   |
| 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）           | 1,215,486,933.76                           | -271,122,517.09 | 944,364,416.67   |
| 项目                        | 上年度可比期间<br>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）           | 1,785,690,040.64                           | 15,286,717.85   | 1,800,976,758.49 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）  | -                                          | -2,519,059.19   | -2,519,059.19    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数      | -670,624,557.14                            | -35,425,547.29  | -706,050,104.43  |
| 其中：1.基金申购款                | 229,182,633.75                             | -429,704.90     | 228,752,928.85   |

|                           |                  |                |                  |
|---------------------------|------------------|----------------|------------------|
| 2. 基金赎回款                  | -899,807,190.89  | -34,995,842.39 | -934,803,033.28  |
| 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）           | 1,115,065,483.50 | -22,657,888.63 | 1,092,407,594.87 |

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

|              |              |              |
|--------------|--------------|--------------|
| _____<br>奚星华 | _____<br>颜锡廉 | _____<br>刘美丽 |
| 基金管理公司负责人    | 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。

### 6.4.2 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        |

### 6.4.4 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

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2012 年 1 月 1 日<br>至 2012 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2011 年 1 月 1 日<br>至 2011 年 6 月 30 日 |
|-----------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 4,551,025.46                              | 6,647,374.83                                   |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,883,838.96                              | 3,227,145.18                                   |

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：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.0\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2012 年 1 月 1 日<br>至 2012 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2011 年 1 月 1 日<br>至 2011 年 6 月 30 日 |
|----------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 910,205.16                                | 1,329,474.92                                   |

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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.2\% / \text{当年天数}。$$

#### 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

本报告期内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其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

单位：人民币元

| 关联方<br>名称 | 本期<br>2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 |           | 上年度可比期间<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 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    | 38,050,094.51                         | 52,313.03 | 35,505,714.20                              | 243,602.35 |

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（2012 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/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中作为抵押的债券

###### 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因从事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事交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

## § 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              | 886,713,923.06 | 93.65         |
|    | 其中：股票             | 886,713,923.06 | 93.65         |
| 2  | 固定收益投资            | 19,370,000.00  | 2.05          |
|    | 其中：债券             | 19,370,000.00  | 2.05          |
|    | 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      | 39,301,018.25  | 4.15          |
| 6  | 其他各项资产            | 1,430,041.43   | 0.15          |
| 7  | 合计                | 946,814,982.74 | 100.00        |

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 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       | -              | -     |
| B   | 采掘业            | 57,805,181.82  | 6.12  |
| C   | 制造业            | 526,309,707.35 | 55.73 |
| C0  | 食品、饮料          | 160,998,671.58 | 17.05 |
| 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    | 21,867,864.81  | 2.32  |
| C5  | 电子             | -              | -     |
| C6  | 金属、非金属         | 110,778,879.76 | 11.73 |
| C7  | 机械、设备、仪表       | 177,228,494.62 | 18.77 |
| C8  | 医药、生物制品        | 55,435,796.58  | 5.87  |
| C99 | 其他制造业          | -              | -     |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | -              | -     |
| E   | 建筑业            | -              | -     |
| F   | 交通运输、仓储业       | -              | -     |
| G   | 信息技术业          | 28,551,745.84  | 3.02  |
| H   | 批发和零售贸易        | 39,622,907.65  | 4.20  |
| I   | 金融、保险业         | 109,657,922.20 | 11.61 |
| J   | 房地产业           | 101,554,716.68 | 10.75 |
| K   | 社会服务业          | 23,211,741.52  | 2.46  |
| L   | 传播与文化产业        | -              | -     |
| M   | 综合类            | -              | -     |
|     | 合计             | 886,713,923.06 | 93.90 |

## 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

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 | 9,477,417 | 84,443,785.47 | 8.94         |
| 2  | 000858 | 五 粮 液 | 1,965,842 | 64,400,983.92 | 6.82         |
| 3  | 000651 | 格力电器  | 2,365,022 | 49,310,708.70 | 5.22         |
| 4  | 000157 | 中联重科  | 4,495,881 | 45,093,686.43 | 4.78         |
| 5  | 000001 | 深发展 A | 2,885,109 | 43,738,252.44 | 4.63         |
| 6  | 002024 | 苏宁电器  | 4,722,635 | 39,622,907.65 | 4.20         |
| 7  | 002304 | 洋河股份  | 255,147   | 34,330,028.85 | 3.64         |
| 8  | 000568 | 泸州老窖  | 761,803   | 32,231,884.93 | 3.41         |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 9  | 000063 | 中兴通讯 | 2,045,254 | 28,551,745.84 | 3.02 |
| 10 | 000776 | 广发证券 | 916,594   | 27,341,999.02 | 2.90 |

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。

### 7.3.2 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。

## 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

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  | 000002 | 万 科 A | 12,063,504.61 | 1.49           |
| 2  | 000858 | 五 粮 液 | 10,302,853.24 | 1.27           |
| 3  | 000651 | 格力电器  | 8,428,635.94  | 1.04           |
| 4  | 000425 | 徐工机械  | 8,247,242.78  | 1.02           |
| 5  | 000001 | 深发展 A | 6,985,120.19  | 0.86           |
| 6  | 002024 | 苏宁电器  | 6,574,899.40  | 0.81           |
| 7  | 000157 | 中联重科  | 6,341,233.78  | 0.78           |
| 8  | 000983 | 西山煤电  | 5,475,453.31  | 0.68           |
| 9  | 002304 | 洋河股份  | 5,098,749.31  | 0.63           |
| 10 | 000792 | 盐湖股份  | 4,982,253.31  | 0.61           |
| 11 | 000063 | 中兴通讯  | 4,836,954.28  | 0.60           |
| 12 | 000568 | 泸州老窖  | 4,735,992.53  | 0.58           |
| 13 | 000869 | 张 裕 A | 4,722,698.50  | 0.58           |
| 14 | 000338 | 潍柴动力  | 4,560,907.62  | 0.56           |
| 15 | 000776 | 广发证券  | 4,262,669.77  | 0.53           |
| 16 | 000527 | 美的电器  | 3,782,032.70  | 0.47           |
| 17 | 000423 | 东阿阿胶  | 3,329,730.58  | 0.41           |
| 18 | 000895 | 双汇发展  | 3,163,041.00  | 0.39           |
| 19 | 000069 | 华侨城 A | 2,981,560.56  | 0.37           |
| 20 | 000629 | 攀钢钒钛  | 2,917,997.00  | 0.36           |

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 | 6,706,238.86 | 0.83           |
| 2  | 000858 | 五 粮 液 | 5,580,726.77 | 0.69           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 3  | 002128 | 露天煤业 | 5,152,813.49 | 0.64 |
| 4  | 000001 | 深发展A | 4,004,618.18 | 0.49 |
| 5  | 002024 | 苏宁电器 | 3,442,353.40 | 0.42 |
| 6  | 000157 | 中联重科 | 3,200,041.75 | 0.39 |
| 7  | 000983 | 西山煤电 | 3,070,541.46 | 0.38 |
| 8  | 000651 | 格力电器 | 2,978,342.73 | 0.37 |
| 9  | 000527 | 美的电器 | 2,686,765.85 | 0.33 |
| 10 | 000338 | 潍柴动力 | 2,369,098.46 | 0.29 |
| 11 | 000568 | 泸州老窖 | 2,327,340.65 | 0.29 |
| 12 | 002304 | 洋河股份 | 2,294,238.21 | 0.28 |
| 13 | 000776 | 广发证券 | 2,287,984.72 | 0.28 |
| 14 | 000423 | 东阿阿胶 | 1,951,410.55 | 0.24 |
| 15 | 000895 | 双汇发展 | 1,742,106.29 | 0.21 |
| 16 | 000758 | 中色股份 | 1,664,936.20 | 0.21 |
| 17 | 000069 | 华侨城A | 1,593,376.96 | 0.20 |
| 18 | 000063 | 中兴通讯 | 1,589,865.60 | 0.20 |
| 19 | 000937 | 冀中能源 | 1,569,677.54 | 0.19 |
| 20 | 000629 | 攀钢钒钛 | 1,508,933.00 | 0.19 |

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 | 153,502,353.81 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 78,020,677.92  |

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”均按成交单价乘以成交数量填列，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      | 19,370,000.00 | 2.05         |
| 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        | 19,370,000.00 | 2.05         |

## 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  | 1101086 | 11 央行票据 86 | 200,000 | 19,370,000.00 | 2.05         |

## 7.7 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。

## 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报告期内没有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。

**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   | 508,404.26   |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 449,492.47   |
| 5  | 应收申购款   | 472,144.70   |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 1,430,041.43 |

### 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 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 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额             | 占总份<br>额比例 |
| 26,317       | 46,186.38     | 119,913,106.41 | 9.87%      | 1,095,573,827.35 | 90.13%     |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 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基金 | 2,245,278.53 | 0.1847%  |

注：1. 本报告期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间：10 万份至 50 万份（含）；

2. 本报告期末本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间：10 万份至 50 万份（含）。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                 |                  |
|---------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2010 年 11 月 15 日）基金份额总额 | 1,848,841,553.44 |
| 本报告期期初基金份额总额                    | 1,107,985,877.46 |
| 本报告期基金总申购份额                     | 221,911,590.53   |
| 减：本报告期基金总赎回份额                   | 114,410,534.23   |
| 本报告期基金拆分变动份额                    | -                |
| 本报告期末基金份额总额                     | 1,215,486,933.76 |

## § 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

本报告期基金管理人、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

本基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内无诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期末未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所有限公司，该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。

## 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

本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 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      | 128,809,140.58 | 55.64%       | 104,657.65 | 55.12%     | -  |
| 海通证券 | 1      | 64,181,974.76  | 27.72%       | 53,900.73  | 28.39%     | -  |
| 华泰证券 | 1      | 26,691,140.78  | 11.53%       | 21,686.75  | 11.42%     | -  |
| 长城证券 | 1      | 11,840,775.61  | 5.11%        | 9,620.64   | 5.07%      | -  |
| 长江证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 平安证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 中金公司 | 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) 资质雄厚，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

(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、本报告期内无变更基金租用交易单元的情况。

#### 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。

融通基金管理有限公司

二〇一二年八月二十九日