天弘精选混合型证券投资基金2009年半年度报告摘要

2009年6月30日

基金管理人:天弘基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2009年8月25日

§1 重要提示及目录

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本基金合同规定,于2009年8月17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2009年1月1日起至2009年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	天弘精选混合
交易代码	420001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年10月8日
报告期末基金份额总额	6,253,764,030.46份

2.2 基金产品说明

投资目标	以资产配置为导向,在股票、债券、短期金融工具等之间进行动态选择,在控制风险的前提下追求基金财产的长期稳健增值
投资策略	在资产配置层次上,本基金以资产配置为导向,力图通过对股票、债券和短期金融工具进行灵活资产配置,在控制风险基础上,获取收益;在行业配置层次上,根据各个行业的景气程度,进行行业资产配置;在股票选择上,本基金将挖掘行业龙头,投资于有投资价值的行业龙头企业;本基金债券投资坚持以久期管理和凸性分析为核心,以稳健的主动投资为主导,选取价值被低估的券种,以获得更高的收益
业绩比较基准	上证180指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%
风险收益特征	本基金为主动管理的混合型基金,其长期平均风险程度低于股票型基金,高于货币市场型基金。本基金力争在严格控制风险的前提下,谋求实现基金财产的长期稳定增长

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		天弘基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕传红	蒋松云
	联系电话	022-83865568	010-66105799
	电子邮箱	lvch@thfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		022-83310988.4007109999	95588
传真		022-83865569	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	www.thfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据及财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2009年1月1日—2009年6月30日
本期已实现收益	484,824,547.88
本期利润	956,112,530.41
加权平均基金份额本期利润	0.1479
本期基金份额净值增长率	31.94%
3.1.2 期末数据和指标	2009年1月1日—2009年6月30日
期末可供分配基金份额利润	-0.1300
期末基金资产净值	3,816,295,175.37
期末基金份额净值	0.6102

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。

3.2 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	7.26%	1.03%	8.30%	0.70%	-1.04%	0.33%
过去三个月	13.53%	1.45%	14.43%	0.86%	-0.90%	0.59%
过去六个月	31.94%	1.64%	36.77%	1.07%	-4.83%	0.57%
过去一年	11.23%	1.71%	12.55%	1.43%	-1.32%	0.28%
过去三年	68.01%	1.86%	71.80%	1.35%	-3.79%	0.51%
自基金合同生效起至今	90.87%	1.71%	113.20%	1.25%	-22.33%	0.46%

注:天弘精选混合业绩比较基准:上证180指数收益率*55%+上证国债指数收益率*45%。上证180指数和上证国债指数由上海证券交易所编制发布,分别反映了中国证券市场和债券市场的整体运行状况,具有可操作性和投资性。本基金股票投资比例范围是30%-85%,债券和短期金融工具的投资比例范围是15%-70%,分别参考上述投资比例范围的中值,确定本基金业绩比较基准,其中上证180指数占55%,上证国债指数占45%。

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

天弘精选混合基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2005年10月8日至2009年6月30日)

注:1、根据本基金合同约定,本基金股票投资比例范围是基金资产的30%—85%,债券和短期金融工具的投资比例范围是基金资产的15%—70%。本报告期内,本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。
2、本基金合同于2005年10月8日生效,建仓期为2005年10月8日至2006年4月7日,建仓期结束时,本基金的各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

§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

天弘基金管理有限公司由天津信托投资有限责任公司、兵器财务有限责任公司和内蒙古君正能源化工股份有限公司共同设立,经中国证监会证监基字[2004]164号文批准,于2004年11月8日正式成立,注册资本金为1亿元人民币。本基金管理人目前管理二只开放式基金:天弘精选混合型证券投资基金、天弘永利债券型证券投资基金、天弘永定价值成长股票型证券投资基金。

4.1.2 基金经理及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
吕宜振	本基金基金经理;基金管理人投资总监。	2009年3月	—	8年	男,工学博士。历任易方达基金管理有限公司研究主管;信诚基金管理有限公司研究总监、信诚精粹成长股票型证券投资基金基金经理。2008年10月起担任天弘基金管理有限公司投资总监。
徐正国	本基金基金经理。	2009年3月	—	5年	男,管理学硕士,2004年加盟天弘基金管理有限公司。历任天弘基金管理有限公司交易员、行业研究员、高级研究员、天弘精选混合型证券投资基金基金经理助理。
许利明	本基金基金经理;基金管理人投资部副总经理。	2007年7月	2009年3月	10年	男,经济学硕士。历任北京国际信托投资公司投资银行总部项目经理;湘财证券有限责任公司资产管理总部总经理助理;北京鹿苑天阁投资顾问公司首席投资顾问。2007年6月加盟天弘基金管理有限公司,历任投资部研究总监、天弘精选混合型证券投资基金基金经理助理。

注:1、上述任职日期、离任日期均为本基金管理人对外披露的任免日期。
2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作,不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规、基金合同的有关规定,勤勉尽责地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。

本报告期内,本基金运作合法合规,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的说明

4.3.1 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,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。根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,公司制定并执行了公平交易管理办法。公平交易管理办法的范围包括各类投资组合、所有投资交易品种、以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资交易管理活动。

公平交易的执行情况包括:公平对待不同投资组合,严禁进行以各投资组合之间利益输送为目的的投资交易活动;在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,严格执行授权审批程序;建立统一的研究平台和公共信息平台,保证各组合得到公平的投资资讯;实行集中交易制度和公平的交易分配制度;加强对投资交易行为的监察稽核力度等。

本报告期内,基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。

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天弘精选混合型证券投资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说明

09年年初,宏观经济延续去年的下滑势头,世界各国都采取规模空前的财政刺激计划和货币放松政策,如奥巴马政府就启动定期资产支持证券贷款工具TALF计划,并在实现零利率政策后,宣布实施“定量宽松”的非常规货币政策,直接承诺购买至多1.5万亿美元的国债和机构证券,同时启动公私联合投资计划(PPIP)处理不良资产。这些规模空前的救市计划产生了效果,全球宏观经济逐渐出现了复苏迹象;包括美国的房地产市场销售和营建许可、美国零售以及汽车销售数据、ISM制造业指数、甚至包括滞后指标、就业状况等多项指标都呈现企稳反弹的走势。而新兴市场国家宏观经济复苏的力度更加强劲。

尽管中国的出口仍然疲软,然而在固定资产投资、房地产和汽车销售为主的内需的强烈拉动下,中国经济回升的态势,在环比意义上衡量是非常强劲的。中国5月名义投资为38.67%,真实投资增速更是达到49.43%;5月零售额实际增速达到17.3%,而用电量指标更是在6月首次回正值,5月份的同步指标工业增加值更是强劲回升到8.9%。而5月份出口同比增幅为-26.4%,虽然仍然疲软,但也已经见底。

09年上半年,在宏观经济复苏的预期和充裕流动性支持下,全球资本市场以及大宗商品纷纷强劲走高。其中上证指数上涨62.53%,沪深300指数上涨74.20%。

鉴于对中国经济在内需拉动下强劲复苏的信心,本基金在上半年操作中始终保持了较高水平的仓位。本基金年初重点配置受益于基建投资的工程机械、水泥以及资源敏感的新能源行业,而后逐步转为重点配置最为受益宏观经济复苏的金融、地产、汽车等行业。期间本基金阶段性参与了“抽胀预期”敏感的有色金属、煤炭等行业,而对于在经济复苏时期表现相对平淡的医药、零售、食品等行业给予了低配。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,我们认为,随着配套资金逐步到位,4万亿”基建项目的拉动效应还将持续;同时,在上半年房地产销售强劲回升消化存货以后,下半年房地产投资增速也有望出现明显的回升。所以我们判断中国经济复苏不仅是强劲的,而且是可持续的。尽管上半年股市出现较大幅度的上涨,但是宏观经济复苏的态势还会加速,流动性依然充裕,我们认为下半年资本市场仍然存在显著的结构性投资机会。房地产投资的回升将带来中游行业的量价提升和盈利恢复,我们认为中游行业(钢铁、化工、电解铝等)具有显著投资机会,同时利润将逐步向上游资源行业(如煤炭)进行传播,我们将关注其投资机会。同时由于流动性仍然充裕,相关受益行业主要是金融和地产行业。我们将努力寻找景气行业中优质的上市公司,争取为投资人创造超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构,负责制定公司所管理基金的基本估值政策,对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督,对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的,负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定,确保基金资产估值的公平、合理,有效维护投资人的利益。估值委员会由公司分管估值业务的高级管理人员、督察长、投资总监、基金运营部负责人及监察稽核部负责人组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组,由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业操作能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金事务人员组成。

基金经理作为估值工作小组的成员之一,在基金估值定价过程中,充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议,参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内,本基金管理人未与任何第三方签定与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

按照本基金基金合同的约定,基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配。本基金本报告期内仍处于亏损状态,未进行利润分配。

§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

2009年上半年,本基金托管人在对天弘精选混合型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

2009年上半年,天弘精选混合型证券投资基金的管理人——天弘基金管理有限公司在天弘精选混合型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,天弘精选混合型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

本托管人依法对天弘基金管理有限公司编制和披露的天弘精选混合型证券投资基金2009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:天弘精选混合型证券投资基金
报告截止日:2009年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.2.1	153,575,608.84	178,915,222.65
结算备付金		21,496,285.53	8,586,487.94
存出保证金		6,602,881.64	1,944,795.81
交易性金融资产	6.4.2.2	3,716,199,230.60	2,925,650,317.38
其中:股票投资		3,148,081,230.60	1,973,921,317.38
基金投资		-	-
债券投资		568,118,000.00	951,729,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.2.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.2.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.2.5	11,396,343.95	15,141,181.46
应收股利		612,059.68	-
应收申购款		285,284.62	162,923.59
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.2.6	-	-
资产总计		3,910,167,694.86	3,130,400,928.83
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008年12月31日
负债:			
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		69,576,084.47	58,647,691.35
应付赎回款		6,357,860.02	956,243.92
应付管理人报酬		4,599,267.68	3,987,026.98
应付托管费		766,544.65	664,504.50
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.2.7	11,656,427.52	3,415,339.31
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.2.8	916,335.15	952,179.38
负债合计		93,872,519.49	68,622,985.44
所有者权益:			
实收基金	6.4.2.9	2,788,449,091.79	2,951,829,587.65
未分配利润	6.4.2.10	1,027,846,083.58	109,948,355.74
所有者权益合计		3,816,295,175.37	3,061,777,943.39
负债和所有者权益总计		3,910,167,694.86	3,130,400,928.83

注:报告截止日2009年6月30日,基金份额净值0.6102元,基金份额总额6,253,764,030.46份。后附6.4报表附注为本财务报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体:天弘精选混合型证券投资基金
本报告期:2009年1月1日至2009年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2009年1月1日至2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日
一、收入		1,023,045,444.13	-2,609,912,899.33
1.利息收入		12,657,901.09	12,634,400.93
其中:存款利息收入	6.4.2.11	625,118.21	2,566,449.11
债券利息收入		12,032,782.88	10,067,951.82
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		538,926,397.10	-645,901,389.70
其中:股票投资收益	6.4.2.12	509,270,252.89	-662,703,731.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.2.13	16,207,455.57	-204,879.11
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.2.14	-	-2,435,976.62
股利收益	6.4.2.15	13,448,688.64	19,443,197.65
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.2.16	471,287,982.53	-1,977,289,678.99
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.2.17	173,163.41	643,768.43
二、费用(以“-”号填列)		-66,932,913.72	-73,109,221.43
1.管理人报酬		-25,688,781.64	-39,410,766.70
2.托管费		-4,281,463.65	-6,568,461.12
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.2.18	-36,333,574.33	-21,910,776.20
5.利息支出		-440,677.06	-5,000,483.40
其中:卖出回购金融资产支出		-440,677.06	-5,000,483.40
6.其他费用	6.4.2.19	-188,417.04	-218,734.01
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		956,112,530.41	-2,683,022,120.76
所得税费用(以“-”号填列)		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		956,112,530.41	-2,683,022,120.76

注:后附6.4报表附注为本财务报表的组成部分。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:天弘精选混合型证券投资基金
本报告期:2009年1月1日至2009年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009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)	2,951,829,587.65	109,948,355.74	3,061,777,943.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	956,112,530.41	956,112,530.41
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-163,380,495.86	-38,214,802.57	-201,595,298.43
其中:1.基金申购款	18,411,888.42	3,876,588.34	22,288,476.76
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-181,792,384.28	-42,091,390.91	-223,883,775.19
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,788,449,091.79	1,027,846,083.58	3,816,295,175.37
项目	上年度可比期间 2008年1月1日至2008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)	2,873,413,702.96	3,123,057,599.89	5,996,471,302.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,683,022,120.76	-2,683,022,120.76
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	219,026,168.56	272,371,008.68	491,397,177.24
其中:1.基金申购款	514,735,882.37	496,265,159.54	1,011,001,041.91
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-295,709,713.81	-223,894,150.86	-519,603,864.67
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	3,092,439,871.52	712,406,487.81	3,804,846,359.33

注:后附6.4报表附注为本财务报表的组成部分。

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声明

6.4.1.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策与最近一期年度会计报表所采用的会计政策一致。。

6.4.1.2 会计估计变更的说明

2008年12月26日,本基金持有的长期停牌股票盐湖钾肥复牌。为更合理反映该股票的公允价值,经与托管行协商,决定自2009年1月5日起对盐湖钾肥的估值,由行业指数收益法变更为参考当日收盘价,经修正的估值方法进行估值。

上述会计估计变更导致本基金持有的特殊事项停牌股票的公允价值于2009年1月5日下调1,759,314.50元,相应调减本基金的净利润1,759,314.50元和基金资产净值1,759,314.50元。

6.4.1.3 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。

6.4.2 关联方关系

6.4.2.1 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

本基金本报告期不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。

6.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内没有通过关联方交易席位进行的交易。

6.4.3.2 关联方报酬

6.4.3.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日
当期应支付的管理费	25,688,781.64	39,410,766.70
其中:当期已支付	21,089,513.96	34,303,043.79
期末未支付	4,599,267.68	5,107,722.91

注:支付基金管理人天弘基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%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:日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

6.4.3.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日
当期应支付的托管费	4,281,463.65	6,568,461.12
其中:当期已支付	3,514,919.00	5,717,173.96
期末未支付	766,544.65	851,287.16

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%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:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期2009年1月1日至2009年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	-	85,355,662.88	-	-	-	-
上年度可比期间2008年1月1日至2008年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	98,216,569.34	-	-	-	-	-

6.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日
期初持有的基金份额	-	61,972,843.65
期间认购总份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分增加的份额	-	-
期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	61,972,843.65
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.89%

6.4.3.4.2 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

本基金管理人之外的其他关联方,如对本基金管理人持股比例最高的主要股东及其控制的机构,在本报告期末(2009年6月30日)及上年度末(2008年12月31日)未持有本基金份额。

6.4.3.5 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 2009年1月1日至2009年6月30日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008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	153,575,608.84	514,460.07	81,811,832.96	2,488,236.87

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。

6.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.4 期末(2009年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末2009年6月30日止,本基金未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.4.2 期末持有的暂时停牌股票

截至本报告期末2009年6月30日止,本基金未持有暂时停牌股票。

6.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2009年6月30日止,本基金未持有银行间市场债券正回购。

6.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2009年6月30日止,本基金未持有交易所市场债券正回购。

§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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益类投资	3,148,081,230.60	80.51
	其中:股票	3,148,081,230.60	80.51
2	固定收益类投资	568,118,000.00	14.53
	其中:债券	568,118,000.00	14.53
3	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	175,071,894.37	4.48
7	其他资产	18,896,569.89	0.48
8	合 计	3,910,167,694.86	100.00

7.2 期末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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	63,926,938.63	1.68
C	制造业	1,052,899,848.74	27.59
C0	食品、饮料	-	-
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	240,533,181.87	6.30
C5	电子	32,007,057.14	0.84
C6	金属、非金属	339,150,341.89	8.89
C7	机械、设备、仪表	343,198,255.40	8.99
C8	医药、生物制品	98,011,012.44	2.57
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	205,190,873.79	5.38
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	21,064,370.88	0.55
G	信息技术业	62,352,333.95	1.63
H	批发和零售贸易	105,358,957.10	2.76
I	金融、保险业	904,851,742.36	23.71
J	房地产业	479,175,962.02	12.56
K	社会服务业	204,774,253.40	5.37
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	48,485,949.73	1.27
	合计	3,148,081,230.60	82.49

7.3 期末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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	深发展A	6,880,596	150,134,604.72	3.93
2	600000	浦发银行	5,642,064	129,880,313.28	3.40
3	600036	招商银行	5,120,100	114,741,441.00	3.01
4	000407	胜利股份	12,523,974	114,594,362.10	3.00
5	000402	金融街	7,767,530	106,881,212.80	2.80
6	000024	招商地产	3,323,759	105,529,348.25	2.77
7	600837	海通证券	6,041,883	99,388,975.35	2.60
8	000425	徐工科技	2,971,771	98,009,007.58	2.57
9	601166	兴业银行	2,619,423	97,206,787.53	2.55
10	600585	海螺水泥	2,284,893	96,285,391.02	2.52

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	600837	海通证券	173,056,613.40	5.65
2	601166	兴业银行	165,698,025.08	5.41
3	000001	深发展A	163,994,009.24	5.36
4	600016	民生银行	159,776,275.66	5.22
5	000983	西山煤电	156,960,571.27	5.13
6	601318	中国平安	154,959,754.46	5.06
7	601168	西部矿业	152,938,781.13	5.00
8	600309	烟台万华	130,926,233.63	4.28
9	000407	胜利股份	128,712,901.82	4.20
10	601088	中国神华	126,101,728.74	4.12
11	000683	远兴能源	122,102,004.54	3.99
12	601186	中国铁建	119,976,559.59	3.92
13	000800	一汽轿车	119,968,397.61	3.92
14	600036	招商银行	119,957,338.37	3.92
15	600104	上海汽车	117,551,982.93	3.84
16	600048	保利地产	116,392,715.53	3.80
17	600029	南方航空	113,182,089.94	3.70
18	600000	浦发银行	110,279,036.40	3.60
19	600997	开滦股份	109,978,439.40	3.59
20	600307	酒钢宏兴	105,273,854.12	3.44
21	600872	中炬高新	103,732,706.37	3.39
22	600011	华能国际	103,320,431.88	3.37
23	000878	云南铜业	101,250,107.92	3.31
24	000402	金融街	101,029,557.29	3.30
25	000157	中联重科	100,969,889.98	3.30
26	600690	青岛海尔	99,931,853.07	3.26
27	600585	海螺水泥	99,927,918.89	3.26
28	000009	中国宝安	99,609,192.27	3.25
29	601169	北京银行	98,797,887.43	3.23
30	601666	平煤股份	98,086,899.23	3.20
31	600795	国电电力	94,937,780.39	3.10
32	600550	天威保变	94,237,404.12	3.08
33	600007	中国国贸	93,721,419.06	3.06
34	600019	宝钢股份	92,987,981.19	3.04
35	601919	中国远洋	91,158,694.75	2.98
36	000060	中金岭南	90,968,449.53	2.97
37	000651	格力电器	90,731,015.48	2.96
38	600153	建发股份	90,057,916.64	2.94
39	600649	城投控股	89,980,162.30	2.94
40	000898	鞍钢股份	89,968,042.46	2.94
41	600428	中远航运	89,962,823.23	2.94
42	600325	华发股份	88,944,913.90	2.91
43	600050	中国联通	84,941,028.95	2.77
44	002073	青岛软控	81,595,315.80	2.66
45	600348	国阳新能	81,539,193.47	2.66
46	000024	招商地产	80,335,397.52	2.62
47	601899	紫金矿业	80,244,055.61	2.62
48	601939	建设银行	79,881,585.74	2.61
49	600109	国金证券	78,970,029.06	2.58
50	600331	宏达股份	76,096,318.43	2.49
51	600316	洪都航空	75,846,223.66	2.48
52	600026	中海发展	74,975,524.55	2.45
53	601002	晋亿实业	74,471,537.63