融通领先成长股票型证券投资基金(LOF) 2009年半年度报告摘要

2009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:中国建设银行股份有限公司
送出日期:二〇〇九年八月二十五日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据融通领先成长股票型证券投资基金(LOF)(以下简称"本基金")基金合同规定,于2009年8月15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2009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	融通领先成长股票(LOF)	
交易代码	161610(前端收费模式)	161660(后端收费模式)
基金运作方式	契约型上市开放式	
基金合同生效日	2007年4月30日	
报告期末基金份额总额	4,836,938,235.16份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2007年7月18日	

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于业绩能持续高速增长的上市公司,通过积极主动的分散化投资策略,在严格控制风险的前提下实现基金资产的持续增长,为基金持有人获取长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金认为股价上升的主要推动力来自于企业盈利的不断增长。在中国经济长期高速增长的大背景下,许多企业在一定时期表现出较高的成长性,但只有符合产业结构发展趋势,同时在技术创新、经营模式、品牌、渠道、成本等方面具有领先优势的企业,才能保持业绩持续高速成长,而这些企业正是本基金重点投资的目标和获得长期超额回报的基础。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中信标普全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是较高预期收益较高预期风险的产品,其预期收益与风险高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴治平	尹东
	联系电话	(0755)26948666	(010)67595003
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	yindong@ccb.cn
客户服务电话		400-883-8088、(0755)26948088	(010)67595096
传真		(0755)26935005	(010)66275853

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	http://www.rtfund.com
基金半年度报告备置地点	深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层融通基金管理有限公司、北京市西城区闹市口大街1号院1号楼中国建设银行投资托管服务部、深圳证券交易所

§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(2009年1月1日-2009年6月30日)
本期已实现收益	-482,952,727.77
本期利润	1,994,586,604.32
加权平均基金份额本期利润	0.3890
本期基金份额净值增长率	58.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期(2009年1月1日-2009年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0253
期末基金资产净值	5,092,494,600.34
期末基金份额净值	1.053

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)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);

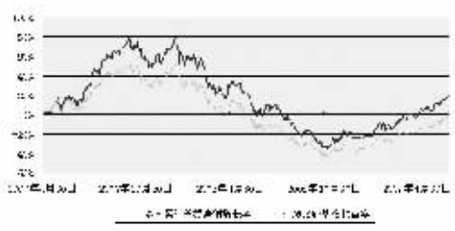
(3)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	14.21%	1.14%	11.64%	0.98%	2.57%	0.16%
过去三个月	24.91%	1.38%	20.76%	1.25%	4.15%	0.13%
过去六个月	58.82%	1.66%	56.63%	1.57%	2.19%	0.09%
过去一年	17.65%	2.05%	13.78%	2.06%	3.87%	-0.01%
自基金合同生效起至今	21.97%	2.12%	-2.59%	2.10%	24.56%	0.02%

3.2.2 自基金转型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:本基金是由原通宝证券投资基金转型而来,合同生效日为2007年4月30日,基金建仓期为合同生效日起六个月,至建仓期结束本基金的各项投资比例均符合基金合同约定。

§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

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2009年6月30日,公司管理的基金共有九只,一只封闭式基金:融通通乾封闭基金,八只开放式基金:融通新蓝筹混合基金、融通通利系列基金、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)和融通内需驱动股票基金,其中融通通利系列基金由融通债券基金、融通深证100指数基金和融通蓝筹成长混合基金三只子基金构成,融通领先成长股票基金(LOF)由封闭式基金基金通宝转型而来。

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期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
陈文涛	本基金的基金经理、研究策划部总监	2007年04月30日	-	11	生物医药学士,具有证券从业资格。曾任武汉生物制品研究所项目工程师、深圳新鹏投资发展有限公司项目工程师、招商证券研究发展中心高级研究员、部门副总经理、招商证券投资管理部副总经理、招商基金管理有限公司股票投资部高级经理。
刘模林	本基金的基金经理、融通新蓝筹混合基金的基金经理、公司副总经理	2007年04月30日	-	15	机械工程硕士,具有证券从业资格。曾任武汉市信托投资公司证券总部研究部经理、花桥证券营业部经理;融通基金管理有限公司研究策划部策略和行业研究员、总监、机构理财部总监、基金管理部总监。

注:任职日期及离任日期均指公司董事会作出决定之日,证券从业年限是以从事证券行业工作的时间来计算的。

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、《融通领先成长股票型证券投资基金(LOF)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

基金名称	本报告期基金份额净值增长率
融通行业景气混合基金	65.76%
融通动力先锋股票基金	45.78%
融通内需驱动股票基金	12.10%
本基金	58.82%

(1)本基金和融通行业景气混合基金的净值增长率差异为-6.94%,其中-4.37%来自资产配置,-4.71%来自行业配置,3.66%来自股票选择,-1.52%其它因素;

(2)本基金和融通动力先锋股票基金的净值增长率差异为13.04%,其中5.00%来自资产配置,-0.73%来自行业配置,8.58%来自股票选择,0.19%来自其它因素;

(3)融通内需驱动股票基金合同生效日2009年4月22日,截止2009年6月30日建仓期尚未结束,不作业绩比较。

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 管理人对报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明

2009年上半年A股市场大幅上涨,上证综合指数上涨62.53%,沪深300指数上涨74.2%,上涨幅度之大超出市场的预期。风格上低价股、低市盈率、绩优股的表现较好,行业上有色金属、地产、采掘涨幅居前,而公用事业、农业、医药涨幅落后。市场的表现充分反应了经济复苏和流动性充裕的特征,周期性行业表现远远好于稳定增长行业。

本基金在报告期内净值上升58.82%,主要是从年初开始较准确地判断了宏观经济和市场的发展趋势,保持了较高的仓位,从行业角度看房地产、煤炭的配置取得较多的正贡献,而消费品配置带来了一定的负贡献。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年市场,经济方面的复苏趋势已完全确立,宏观数据有望快速向好。流动性方面虽然下半年信贷增速将有所降低,但存款活期化的趋势已开始出现,这将极大地支持资产价格的上升。如果在下半年货币政策仍能保持稳定,不进行根本性的改变,证券市场振荡上行的态势将不会改变。从行业方面,经济复苏的重心已从早周期的汽车、地产行业向中游行业渐进,随着中游行业的全面复苏,上游原材料的复苏将更加强劲,同时外围经济复苏也为我们带来投资机会。本基金在下半年将重点关注资产、资源、大宗原材料和外需相关公司的投资机会,争取更多的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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,公司设立由研究策划部、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。其中研究策划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,金融工程部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

根据《证券投资基金运作管理办法》及本基金的基金合同等规定,本基金管理人决定本基金本报告期暂不进行利润分配。

§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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在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

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§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:融通领先成长股票型证券投资基金(LOF)

报告截止日:2009年6月30日

单位:人民币元

资 产	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	418,611,466.69	347,699,050.22
结算备付金	7,496,925.88	728,180.29
存出保证金	4,969,453.94	647,804.95
交易性金融资产	4,761,177,421.06	3,082,865,063.01
其中:股票投资	4,664,897,421.06	2,888,375,063.01
基金投资	-	-
债券投资	96,280,000.00	194,490,000.00
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	-	73,193,176.35
应收利息	3,751,727.48	4,732,875.12
应收股利	-	-
应收申购款	672,863.84	103,404.72
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	5,196,679,858.89	3,509,969,554.66
负债和所有者权益	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	-	-
应付赎回款	92,498,708.44	1,518,789.45
应付管理人报酬	6,083,866.59	4,651,862.70
应付托管费	1,013,977.78	775,310.45
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,428,991.08	1,611,583.02
应交税费	65,649.13	65,649.13
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,094,065.53	569,173.82
负债合计	104,185,258.55	9,192,368.57
所有者权益:		
实收基金	1,878,596,098.70	2,051,734,361.72
未分配利润	3,213,898,501.64	1,449,042,824.37
所有者权益合计	5,092,494,600.34	3,500,777,186.09
负债和所有者权益总计	5,196,679,858.89	3,509,969,554.66

注:报告截止日2009年6月30日,基金份额净值1.053元,基金份额总额4,836,938,235.16份。

6.2 利润表

会计主体:融通领先成长股票型证券投资基金(LOF)

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	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日
一、收入	2,047,842,490.21	-3,370,773,176.76
1.利息收入	4,828,085.27	4,482,430.37
其中:存款利息收入	1,921,783.89	4,481,925.38
债券利息收入	2,906,301.38	504.99
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(损失以"-"填列)	-434,954,341.35	-161,539,814.00
其中:股票投资收益	-462,769,507.24	-183,986,997.92
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-28,600.00	56,877.12
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	184,727.25
股利收益	27,843,765.89	22,205,579.55
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	2,477,539,332.09	-3,216,244,136.59
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	429,414.20	2,528,343.46
二、费用(以"-"号填列)	-53,255,885.89	-99,313,744.09
1.管理人报酬	-31,724,499.92	-54,269,758.05
2.托管费	-5,287,416.70	-9,044,959.66
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	-15,959,387.13	-35,701,524.18
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	-284,582.14	-297,502.20
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	1,994,586,604.32	-3,470,086,920.85
所得税费用(以"-"号填列)	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	1,994,586,604.32	-3,470,086,920.85

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:融通领先成长股票型证券投资基金(LOF)

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)	2,051,734,361.72	1,449,042,824.37	3,500,777,186.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,994,586,604.32	1,994,586,604.32
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)	-173,138,263.02	-229,730,927.05	-402,869,190.07
其中:1.基金申购款	33,305,116.96	40,423,577.10	73,728,694.06
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-206,443,379.98	-270,154,504.15	-476,597,884.13
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)	1,878,596,098.70	3,213,898,501.64	5,092,494,600.34
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)	2,453,913,818.51	7,133,634,351.69	9,587,548,170.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,470,086,920.85	-3,470,086,920.85
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)	-279,875,851.16	-657,465,826.68	-937,341,677.84
其中:1.基金申购款	310,819,077.38	783,021,868.65	1,093,840,946.03
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-590,694,928.54	-1,440,487,695.33	-2,031,182,623.87
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)	-	-172,275,305.87	-172,275,305.87
五、期末所有者权益(基金净值)	2,174,037,967.35	2,833,806,298.29	5,007,844,265.64

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 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。

6.4.2.2 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
新时代证券有限责任公司(新时代证券)	基金管理人股东、基金代销机构
融通基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行	基金托管人、基金代销机构

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

6.4.3.1.1 股票交易

金额单位: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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
新时代证券	1,543,594,007.34	14.84%	559,576,246.44	5.18%
合计	1,543,594,007.34	14.84%	559,576,246.44	5.18%

6.4.3.1.2 权证交易

本报告期及上年度同期,本基金均未通过关联方的交易单元进行权证交易。

6.4.3.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
新时代证券	1,312,047.10	15.11%	768,656.20	22.42%
合计	1,312,047.10	15.11%	768,656.20	22.42%
关联方名称	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
新时代证券	475,637.91	5.25%	475,637.91	9.33%
合计	475,637.91	5.25%	475,637.91	9.33%

注:上述佣金按市场佣金率计算,扣除券商需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买(卖)证管费等)。

管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括:为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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	31,724,499.92	54,269,758.05
其中:当期已支付	25,640,633.33	47,602,764.98
期末未支付	6,083,866.59	6,666,993.07

注:(1)基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。基金管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人:

计算方法如下:H=E×1.5%/当年天数;H为每日应支付的基金管理费;E为前一日的基金资产净值;

(2)上述表格中"当期已支付"的金额不包含上年应付管理费的金额。

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	5,287,416.70	9,044,959.66
其中:当期已支付	4,273,438.92	7,933,794.15
期末未支付	1,013,977.78	1,111,165.51

注:(1)基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取;

计算方法如下:H=E×0.25%/当年天数;H为每日应支付的基金托管费;E为前一日的基金资产净值;

(2)上述表格中"当期已支付"的金额不包含上年应付托管费的金额。

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

本基金本报告期及上年度同期均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.3.4 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	44,418,366	44,418,366
期间认购总份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	44,418,366	44,418,366
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.92%	0.79%

注:上述基金份额的交易费用按交易所公布的公允的基金交易费率计算并支付。

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

本报告期末和上年度末,基金管理人主要股东及其控制的机构未持有本基金份额。

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
中国建设银行	418,611,466.69	1,868,147.08	492,152,227.23	4,418,299.59

6.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期和上年度同期均未于承销期内参与关联方所承销的证券。

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

金额单位:人民币元

6.4.4.1.1 受限证券类别:股票								
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额
600583	海油工程	2008-12-31	2009-12-31	非公开发行流通受限	11.55	9.68	2,250,000	17,325,000.00	21,780,000.00

注:(1)本基金于2008年12月31日认购海油工程非公开发行股票,认购数量1,500,000股,2009年5月26日,海油工程实施每10股送1股,转增4股,上表中的数量为送股和转增实施后的总股数;

(2)除上述股票外,本基金于本报告期未无其他因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.4.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本报告期末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

本基金于本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

§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	4,664,897,421.06	89.77
	其中:股票	4,664,897,421.06	89.77
2	固定收益投资	96,280,000.00	1.85
	其中:债券	96,280,000.00	1.85
	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	426,108,392.57	8.20
6	其他资产	9,394,045.26	0.18
7	合计	5,196,679,858.89	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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	504,596,254.32	9.91
C	制造业	1,650,687,783.58	32.41
C0	食品、饮料	421,204,619.90	8.27
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	17,910,153.00	0.35
C4	石油、化学、塑胶、塑料	187,520,718.42	3.68
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	314,728,348.03	6.18
C7	机械、设备、仪表	601,110,985.35	11.80
C8	医药、生物制品	108,212,958.88	2.12
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	145,267,583.40	2.85
H	批发和零售贸易	325,320,333.69	6.39
I	金融、保险业	1,146,558,503.41	22.51
J	房地产业	523,098,969.10	10.27
K	社会服务业	271,700,000.00	5.34
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	97,667,993.56	1.92
	合计	4,664,897,421.06	91.60

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	占基金资产净值比例(%)
1	601166	兴业银行	8,009,955	297,249,430.05	5.84
2	000069	华侨城A	13,000,000	271,700,000.00	5.34
3	601318	中国平安	5,000,000	247,300,000.00	4.86
4	600519	贵州茅台	1,609,990	238,294,619.90	4.68
5	000651	格力电器	10,500,000	219,450,000.00	4.31
6	000001	深发展A	9,000,000	196,380,000.00	3.86
7	600331	宏达股份	11,801,178	187,520,718.42	3.68
8	600000	浦发银行	8,000,000	184,160,000.00	3.62
9	000046	泛海建设	9,182,109	182,723,969.10	3.59
10	601088	中国神华	6,000,000	179,460,000.00	3.52

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)的半年度报告正文。

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	601318	中国平安	212,776,737.85	6.08
2	601088	中国神华	187,032,655.23	5.34
3	600016	民生银行	172,421,135.30	4.93
4	601166	兴业银行	163,701,253.09	4.68
5	600089	特变电工	157,674,631.46	4.50
6	000002	万 科A	150,609,837.04	4.30
7	000001	深发展A	149,741,755.09	4.28
8	000983	西山煤电	143,465,258.73	4.10
9	000933	神火股份	137,933,245.95	3.94
10	600036	招商银行	124,197,140.22	3.55
11	600030	中信证券	119,208,324.74	3.41
12	000709	唐钢股份	115,739,647.20	3.31
13	600331	宏达股份	109,446,467.85	3.13
14	000792	盐湖钾肥	109,045,827.49	3.11
15	000402	金 融 街	104,704,095.09	2.99
16	000157	中联重科	101,193,662.56	2.89
17	600048	保利地产	100,610,218.74	2.87
18	600585	海螺水泥	99,006,349.28	2.83
19	601328	交通银行	89,346,494.33	2.55
20	000937	金牛能源	85,364,008.50	2.44
21	600307	酒钢宏兴	78,358,212.83	2.24
22	002202	金风科技	77,304,023.29	2.21
23	600519	贵州茅台	76,910,641.52	2.20
24	600029	南方航空	76,691,206.13	2.19
25	601899	紫金矿业	74,404,161.03	2.13
26	600000	浦发银行	72,420,631.50	2.07

注:"买入金额"是按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	600036	招商银行	284,657,554.68	8.13
2	002024	苏宁电器	231,840,052.65	6.62
3	000568	泸州老窖	218,398,092.58	6.24
4	600547	山东黄金	185,765,807.31	5.31
5	000012	南 玻A	166,371,758.34	4.75
6	000933	神火股份	160,233,306.00	4.58
7	600000	浦发银行	153,122,724.73	4.37
8	601318	中国平安	152,253,103.72	4.35
9	600519	贵州茅台	151,413,723.87	4.33
10	600030	中信证券	123,043,472.95	3.51
11	000792	盐湖钾肥	115,082,407.65	3.29
12	000983	西山煤电	108,664,090.94	3.10
13	600089	特变电工	95,994,144.21	2.74
14	000069	华侨城A	95,657,721.42	2.73
15	600048	保利地产	92,471,534.96	2.64
16	000937	金牛能源	86,598,799.56	2.47
17	600017	日照港	82,483,756.22	2.36
18	600750	江中药业	81,066,184.29	2.32
19	601899	紫金矿业	79,656,700.64	2.28
20	600029	南方航空	75,241,276.57	2.15
21	000001	深发展A	71,746,384.11	2.05

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	5,082,067,260.94
卖出股票收入(成交)总额	5,322,396,127.74

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