融通行业景气证券投资基金 2009年半年度报告摘要

基金管理人:融通基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
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。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。

基金托管人交通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2009年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	融通行业景气混合	
交易代码	161606(前端收费模式)	161656(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	2004年04月29日	
报告期末基金份额总额	4,602,964,230.93份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	通过把握行业发展趋势、行业景气程度以及市场运行趋势为持有人获取长期稳定的投资收益。
投资策略	在对市场趋势判断的前提下,重视仓位选择和行业配置,强调以行业为导向进行个股选择,投资于具有良好成长性的行业及其上市公司股票,把握由市场需求、技术进步、国家政策、行业整合等因素带来的行业性投资机会。公司基本面是行业投资价值的直接反映,将结合行业景气情况选择该行业内最具代表性的上市公司作为投资对象。
业绩比较基准	70%×上证综合指数+30%×银行间债券综合指数。
风险收益特征	在锁定可承受风险的基础上,追求较高收益。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴冶平	张咏东
	联系电话	(0755)26948666	(021)68888917
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	zhangyd@bankcomm.com
客户服务电话		400-883-8088、(0755)26948088	95559
传真		(0755)26935005	(021)58408836

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;上海市银城中路188号15楼交通银行股份有限公司资产托管部。

§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	-792,601,062.19
本期利润	1,712,459,419.56
加权平均基金份额本期利润	0.3631
本期基金份额净值增长率	65.76%
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	-0.7558
期末基金资产净值	4,212,659,711.17
期末基金份额净值	0.915

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	12.82%	1.29%	8.61%	0.80%	4.21%	0.49%
过去三个月	27.97%	1.63%	17.11%	0.98%	10.86%	0.65%
过去六个月	65.76%	1.88%	41.62%	1.24%	24.14%	0.64%
过去一年	18.52%	2.31%	9.80%	1.66%	8.72%	0.65%
过去三年	119.75%	2.17%	61.22%	1.60%	58.53%	0.57%
自基金合同生效起至今	209.10%	1.78%	73.88%	1.37%	135.22%	0.41%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金的建仓期为自基金合同生效日之日起6个月,至建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邹曦	本基金的基金经理、融通内需驱动股票基金基金经理	2007年6月25日	-	9	金融学硕士,具有证券从业资格。曾就职于中国航空技术进出口总公司福建分公司;2001年至今就职于融通基金管理有限公司,历任市场拓展部总监助理、机构理财部总监助理、行业分析师、宏观策略分析师等职务。

注:任职日期和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、《融通行业景气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

基金名称	本报告期基金份额净值增长率
融通领先成长股票基金(LOF)	58.82%
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	65.76%

(1)本基金和融通领先成长股票基金(LOF)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%来自其它因素。

(2)本基金和融通动力先锋股票基金的净值增长率差异为19.98%,其中9.37%来自资产配置,3.98%来自行业配置,4.92%来自股票选择,1.71%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,沪深300指数涨幅74.20%。经济走出谷底出现复苏迹象,银行贷款规模保持高速增长,为股票市场提供了盈利和流动性的双重支持。资产类和资源类股票成为上涨的领先板块。

从上半年的投资结果来看,本基金净值增长率为65.76%,跑赢基准且在同业中排名靠前。基于对市场的乐观,本基金上半年一直保持较高的股票仓位,主要超额收益来自对房地产、汽车等经济先导性行业的超比例配置,以及对保险,有色金属等高β行业的超比例配置。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从全球的宏观背景来看,以美国为代表的发达经济体在走出衰退之后将维持较低水平的增长,其根源在于美国各相关主体的资产负债表需要修复,需要从海外借债或透支未来的收入,"偿钱度日"。预计在今后相当长一段时期内,全球经济将处于"低增长,低通胀"的状态。中国经济受到外部需求和增长信心的双重打击,在2008年4季度进入增速下滑的谷底,随后在去库存顺利进行、政府积极的财政刺激和投资拉动、货币政策宽松和银行猛烈发放贷款、良好的资产负债表和庞大的刚性需求等因素的共同作用下,经济率先走出V型的谷底。目前,中国经济已经进入反转阶段,经济处于互相刺激的正向循环,低杠杆率,以及城市化和工业化进程的推进为中国经济反转提供了强劲的动力,在低通胀的背景下,可以预计中国将迎来一段时期的良性发展。

2009年上半年在盈利复苏状况尚不明确和充裕流动性的作用下,A股市场表现为预期引导的行情,而基于上一波牛市中对通货膨胀的深刻记忆,预期的方向指向了资产和资源,市场的表现类似于2006-2007年牛市的"快进版",这种状况在三季度的前一段时间仍将持续。从下半年整体来说,随着盈利复苏状况的明确和流动性充裕状况的减弱,预计市场整体将进入温和上涨阶段,盈利复苏将成为投资主线,部分需求强劲增长,成本大幅下降的中下游行业,主要是工业制成品行业盈利增长将会较高,有可能获得明显的超额收益。

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》及本基金基金合同的相关规定,本基金本报告期不进行利润分配。

§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

2009年上半年度,基金托管人在融通行业景气证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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年上半年度,融通基金管理有限公司在融通行业景气证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

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

2009年上半年度,由融通基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关融通行业景气证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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:融通行业景气证券投资基金

报告截止日:2009年06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	144,230,944.33	31,828,908.10
结算备付金	153,840,889.75	215,524,657.75
存出保证金	3,339,107.87	904,233.02
交易性金融资产	3,921,586,205.66	2,333,292,252.08
其中:股票投资	3,825,146,205.66	2,169,377,252.08
基金投资	-	-
债券投资	96,440,000.00	163,915,000.00
资产支持证券投资	0.00	0.00
衍生金融资产	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00
应收证券清算款	0.00	106,618,615.76
应收利息	3,525,591.98	5,981,252.79
应收股利	0.00	0.00
应收申购款	6,930,229.12	563,582.64
其他资产	0.00	0.00
资产总计	4,233,452,968.71	2,694,713,502.14
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	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	0.00
应付证券清算款	0.00	0.00
应付赎回款	11,884,703.27	1,524,934.36
应付管理人报酬	4,972,324.90	3,686,606.82
应付托管费	828,720.82	614,434.46
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,575,988.24	1,403,012.56
应交税费	47,760.00	47,760.00
应付利息	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,483,760.31	1,382,491.41
负债合计	20,793,257.54	8,659,239.61
所有者权益:		
实收基金	4,602,964,230.93	4,868,350,688.20
未分配利润	-390,304,519.76	-2,182,296,425.67
所有者权益合计	4,212,659,711.17	2,686,054,262.53
负债和所有者权益总计	4,233,452,968.71	2,694,713,502.14

注:报告截止日2009年6月30日,基金份额净值元0.915元,基金份额总额4,602,964,230.93份。

6.2 利润表

会计主体:融通行业景气证券投资基金

本报告期:2009年01月01日至2009年06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	1,751,651,372.92	-3,286,294,317.50
1.利息收入	3,443,107.35	7,762,625.53
其中:存款利息收入	1,379,616.43	3,585,513.18
债券利息收入	2,063,490.92	4,177,112.35
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售金融资产收入	0.00	0.00
其他利息收入	0.00	0.00
2.投资收益(损失以"-"填列)	-757,146,820.98	-1,895,231,018.97
其中:股票投资收益	-773,772,406.36	-1,925,775,400.46
基金投资收益	-	-
债券投资收益	19,545.13	914,405.51
资产支持证券投资收益	0.00	0.00
衍生工具收益	0.00	3,205,005.76
股利收益	16,606,040.25	26,424,970.22
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	2,505,060,481.75	-1,400,066,110.62
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	294,604.80	1,240,186.56
二、费用	-39,191,953.36	-92,289,050.29
1.管理人报酬	-25,052,399.19	-46,097,942.17
2.托管费	-4,175,399.87	-7,682,990.34
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	-9,751,410.78	-38,150,403.03
5.利息支出	0.00	-126,245.52
其中:卖出回购金融资产支出	0.00	-126,245.52
6.其他费用	-212,743.52	-231,469.23
三、利润总额	1,712,459,419.56	-3,378,583,367.79
所得税费用(以"-"号填列)	-	-
四、净利润	1,712,459,419.56	-3,378,583,367.79

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:融通行业景气证券投资基金

本报告期:2009年01月01日至2009年06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)	4,868,350,688.20	-2,182,296,425.67	2,686,054,262.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,712,459,419.56	1,712,459,419.56
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)	-265,386,457.27	79,532,486.35	-185,853,970.92
其中:1.基金申购款	443,718,520.09	-97,253,873.12	346,464,646.97
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-709,104,977.36	176,786,359.47	-532,318,617.89
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)	-	0.00	0.00
五、期末所有者权益(基金净值)	4,602,964,230.93	-390,304,519.76	4,212,659,711.17
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)	5,886,278,023.76	2,125,430,311.48	8,011,708,335.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,378,583,367.79	-3,378,583,367.79
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)	-643,632,919.25	56,497,207.65	-587,135,711.60
其中:1.基金申购款	926,695,171.86	248,804,484.45	1,175,499,656.31
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-1,570,328,091.11	-192,307,276.80	-1,762,635,367.91
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)	-	0.00	0.00
五、期末所有者权益(基金净值)	5,242,645,104.51	-1,196,655,848.66	4,045,989,255.85

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
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
交通银行股份有限公司(交通银行")	基金托管人、基金代销机构
新时代证券有限责任公司(新时代证券")	基金管理人的股东、基金代销机构

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	-	-	31,860,648.19	0.29%

6.4.3.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.3.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.3.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.3.1.5 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	-	-	-	-
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	27,081.68	0.29%	27,081.68	0.67%

注:上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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	25,052,399.19	46,097,942.17
其中:当期已支付	20,080,074.29	40,544,847.33
期末未支付	4,972,324.90	5,553,094.84

注:(1)支付基金管理人融通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。

(2)上述表格中"当期已支付"的金额不包含本年已支付的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	4,175,399.87	7,682,990.34
其中:当期已支付	3,346,679.05	6,757,474.55
期末未支付	828,720.82	925,515.79

注:(1)支付基金托管人交通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。

(2)上述表格中"当期已支付"的金额不包含本年已支付的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

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
-	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
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
交通银行	96,144,178.69	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

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

本报告期及上年度同期,本基金的基金管理人均未投资于本基金。

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

本报告期末及上年度末,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
交通银行	144,230,944.33	433,749.85	23,761,255.51	1,078,193.85

注:本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管,按银行同业利率计息。本基金用于证券交易结算的资金通过"交通银行基金托管结算资金专用存款账户"转存于中国证券登记结算有限责任公司,按银行同业利率计息。于2009年6月30日的相关余额(150,469,397.45元)在资产负债表中的"结算备付金"科目中单独列示(2008年6月30日:62,179,244.03元)。

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

6.4.11.1.1 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	1,500,000	17,325,000.00	14,520,000.00
600583	海油工程	2009-5-26	2009-12-31	非公开发行流通受限	-	9.68	750,000	-	7,260,000.00

注: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1,500,000.00股,认购单价11.55元,2009年5月26日,海油工程实施2008年度每10股派发股票股利1股和资本公积金每10股转增4股分红方案。

6.4.4.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,825,146,205.66	90.36
	其中:股票	3,825,146,205.66	90.36
2	固定收益投资	96,440,000.00	2.28
	其中:债券	96,440,000.00	2.28
	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	298,071,834.08	7.04
6	其他资产	13,794,928.97	0.33
7	合计	4,233,452,968.71	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	123,348,158.60	2.93
C	制造业	1,347,067,561.50	31.98
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	71,505,000.00	1.70
C5	电子	41,444,000.00	0.98
C6	金属、非金属	536,944,544.06	12.75
C7	机械、设备、仪表	640,733,217.44	15.21
C8	医药、生物制品	46,135,800.00	1.10
C99	其他制造业	10,305,000.00	0.24
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	198,091,804.94	4.70
H	批发和零售贸易	168,524,781.57	4.00
I	金融、保险业	855,677,287.92	20.31
J	房地产业	923,175,008.33	21.91
K	社会服务业	150,568,448.80	3.57
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	58,693,154.00	1.39
	合计	3,825,146,205.66	90.80

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	600048	保利地产	8,900,000	248,221,000.00	5.89
2	000046	泛海建设	10,759,960	214,123,204.00	5.08
3	600383	金地集团	12,544,934	202,224,336.08	4.80
4	601318	中国平安	3,900,000	192,894,000.00	4.58
5	000024	招商地产	5,299,999	168,274,968.25	3.99
6	600000	浦发银行	7,000,000	161,140,000.00	3.83
7	000069	华侨城A	7,204,232	150,568,448.80	3.57
8	000898	鞍钢股份	11,274,432	148,709,758.08	3.53
9	601166	兴业银行	3,900,000	144,729,000.00	3.44
10	000651	格力电器	5,500,000	114,950,000.00	2.73

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	000046	泛海建设	122,266,930.19	4.55
2	600030	中信证券	113,311,113.01	4.22
3	000651	格力电器	111,516,965.50	4.15
4	000898	鞍钢股份	104,793,610.64	3.90
5	601600	中国铝业	89,893,521.29	3.35
6	000800	一汽轿车	89,714,874.35	3.34
7	600383	金地集团	89,663,817.22	3.34
8	600547	山东黄金	86,157,654.68	3.21
9	601601	中国太保	72,425,951.24	2.70
10	600331	宏达股份	69,448,596.89	2.59
11	600104	上海汽车	65,871,441.68	2.45
12	000060	中金岭南	64,961,764.47	2.42
13	000878	云南铜业	58,049,223.92	2.16
14	600690	青岛海尔	57,194,959.08	2.13
15	600031	三一重工	53,332,558.61	1.99
16	000157	中联重科	52,148,291.08	1.94
17	600307	酒钢宏兴	47,196,987.55	1.76
18	600048	保利地产	46,629,174.43	1.74
19	600029	南方航空	45,883,491.66	1.71
20	000527	美的电器	43,997,330.11	1.64

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	601628	中国人寿	274,202,518.86	10.21
2	600036	招商银行	218,835,949.93	8.15
3	600048	保利地产	166,099,357.95	6.18
4	000568	泸州老窖	145,097,174.19	5.40
5	000651	格力电器	106,730,392.04	3.97
6	600519	贵州茅台	101,722,801.15	3.79
7	000157	中联重科	98,671,858.32	3.67
8	000898	鞍钢股份	91,928,531.98	3.42
9	000001	深发展A	76,517,286.04	2.85
10	600000	浦发银行	73,868,323.44	2.75
11	600030	中信证券	69,182,236.59	2.58
12	600031	三一重工	59,057,729.54	2.20
13	000792	盐湖钾肥	56,808,639.42	2.11
14	000002	万 科A	56,475,129.30	2.10
15	600546	中油化建	56,018,258.18	2.09
16	000759	武汉中百	54,447,580.62	2.03
17	000527	美的电器	52,643,836.01	1.96
18	601601	中国太保	52,608,098.22	1.96
19	601318	中国平安	52,066,722.89	1.94
20	600029	南方航空	51,863,240.73	1.93

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	3,150,842,845.54
卖出股票收入(成交)总额	3,227,896,312.48

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	96,440,000.