融通新蓝筹证券投资基金 2009年半年度报告摘要

2009年6月30日

基金管理人: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新蓝筹证券投资基金(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。

本报告中的财务资料未经审计。

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	融通新蓝筹混合	
交易代码	161601(前端收费模式)	161602(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	2002年9月13日	
报告期末基金份额总额	20,578,243,716.93份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	主要投资于处于成长阶段和成熟阶段早期的"新蓝筹"上市公司。通过组合投资,在充分控制风险的前提下实现基金净值的稳定增长,为基金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,同时更重视基本面分析,强调通过基本面分析挖掘个股。在正常市场状况下,股票投资比例浮动范围:30-75%;债券投资比例浮动范围:20-55%,现金留存比例浮动范围:不低于5%。
业绩比较基准	本基金股票投资部分的比较基准是"国泰君安指数";为便于基金业绩比较,参照其他多数基金业绩比较基准的设定方式,本报告中暂以"国泰君安指数×75%+银行间债券综合指数×25%"作为本基金的业绩比较基准。
风险收益特征	在适度风险下追求较高收益。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴冶平	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

§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	-414,409,850.12
本期利润	5,248,905,853.48
加权平均基金份额本期利润	0.2498
本期基金份额净值增长率	42.11%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2009年1月1日-2009年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.3077
期末基金资产净值	17,388,709,851.43
期末基金份额净值	0.8450

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	10.72%	0.95%	8.63%	0.79%	2.09%	0.16%
过去三个月	22.59%	1.35%	17.44%	1.12%	5.15%	0.23%
过去六个月	42.11%	1.32%	53.18%	1.47%	-11.07%	-0.15%
过去一年	18.33%	1.28%	17.51%	1.93%	0.82%	-0.65%
过去三年	142.84%	1.59%	94.50%	1.82%	48.34%	-0.23%
自基金合同生效起至今	339.09%	1.26%	74.69%	1.43%	264.40%	-0.17%

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:本基金合同规定,基金建仓期为自基金合同生效之日起6个月,建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合合同约定。

§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		
刘模林	本基金的基金经理、融通领先成长基金(LOF)的基金经理,公司副总经理	2004年07月21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。
戴春平	本基金的基金经理	2007年09月28日	2009年07月23日	10	博士研究生,具有证券从业资格。先后在泰康保险资产管理中心、鹏华基金管理公司、中国人寿资产管理公司从事交易、研究和投资管理工作,07年初进入融通基金管理公司。

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、《融通新蓝筹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

本报告期,本基金与公司管理的投资风格相似的其他基金之间的净值增长率差异未超过5%。

基金名称	本报告期基金份额净值增长率
融通蓝筹成长混合基金	41.57%
本基金	42.11%

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

上半年,中国A股市场以牛市姿态引领全球资本市场。沪深300指数上升74.20%,让参与者深深震撼于3年来气势磅礴的趋势力量与物极必反两者交替出现的景观。

全球的货币供应处于历史上最宽松的时代,发达国家名义利率在零附近。中国上半年的信贷新增规模高达7.36万亿;社会固定资产投资增长33.5%达到9.13万亿;GDP增长从一季度的底部6.1%快速回升到二季度的7.9%。以中国为代表的新兴经济体的增长,驱动大宗商品和国际股市相继在一季度走出底部。A股市场方面,整体估值中枢大幅上升,金融、地产、煤炭、资源股涨幅居前。

报告期融通新蓝筹基金取得42.11%的净值增长。如一季报所述,本基金在09年2月进行了组合重大调整——从08年全年的低仓位策略,大幅提升股票仓位,构建成长性进攻组合。尽管基金规模超百亿,上半年在优选行业和精选个股的结合上,仍然取得了比较满意的效果。重点投资的银行、地产、煤炭股均获得了突出的涨幅,重仓品种带来了明显的超额收益;而制造业则采取了精选个股,新能源方面我们没有作短线的考虑,而是在产业链的资源、制造、应用中分别选择了我们最认可的公司。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计A股市场可能处于趋势性震荡上升的格局;同时从产业标准看许多股票高估的风险也很突出。宏观方面,以中国为龙头的新兴国家的增长将继续引领全球复苏;发达国家已经在2季度确立底部,但由于资产负债表和消费模式的调整需要时间,其恢复增长仍然处于较低水平的回升阶段。另一方面,国内经济恢复加快、资产价格泡沫化趋势的背景下,信贷等方面政策的微调已经在进行当中,但低利率宽松货币政策整体格局仍将持续。

A股方面,下半年投资机会可能将从资源资产主线,延伸到受益于经济复苏的钢铁机械化工等中游制造业板块;综合而言,资产和资源仍是09年的主旋律。

本基金将继续贯彻优选行业和精选个股的策略。继续重视资源资产主线的同时,挖掘受益于经济复苏预期的中游制造业的投资机会。

我们将一如既往地秉承勤勉尽责的精神,为持有人谋求良好的长期回报!

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

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:融通新蓝筹证券投资基金

报告截止日:2009年6月30日

单位:人民币元

资产	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	2,021,900,228.23	2,009,587,450.05
结算备付金	33,115,693.37	879,586.82
存出保证金	14,511,365.26	2,324,561.77
交易性金融资产	15,401,331,008.27	10,619,987,381.48
其中:股票投资	10,847,699,491.07	4,598,550,390.56
基金投资	-	-
债券投资	4,553,631,517.20	6,021,436,990.92
资产支持证券投资	0.00	0.00
衍生金融资产	0.00	30,579,242.20
买入返售金融资产	0.00	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00
应收利息	100,255,796.03	133,906,646.59
应收股利	162.00	0.00
应收申购款	3,519,738.93	764,421.19
递延所得税资产	-	-
其他资产	0.00	0.00
资产总计	17,574,633,992.09	12,798,029,290.10
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	-	-
卖出回购金融资产款	0.00	0.00
应付证券清算款	112,869,650.69	61,289,054.57
应付赎回款	30,358,636.71	6,596,679.68
应付管理人报酬	20,749,033.60	16,579,815.03
应付托管费	3,458,172.26	2,763,302.50
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	14,946,964.28	4,731,768.52
应交税费	1,967,377.38	1,967,377.38
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	1,574,305.74	1,420,321.47
负债合计	185,924,140.66	95,348,319.15
所有者权益:		
实收基金	20,578,243,716.93	21,361,657,384.55
未分配利润	-3,189,533,865.50	-8,658,976,413.60
所有者权益合计	17,388,709,851.43	12,702,680,970.95
负债和所有者权益总计	17,574,633,992.09	12,798,029,290.10

注:截止2009年6月30日,基金份额净值0.8450元,基金份额总额20,578,243,716.93份。

6.2 利润表

会计主体:融通新蓝筹证券投资基金

本报告期:2009年1月1日至2009年6月30日

单位:人民币元

资产	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	5,443,802,370.69	-8,001,217,997.84
1.利息收入	81,555,253.27	114,446,129.11
其中:存款利息收入	5,756,112.67	11,440,972.37
债券利息收入	75,799,140.60	103,005,156.74
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)	-303,171,505.81	-3,592,879,859.05
其中:股票投资收益	-374,232,811.81	-3,571,550,815.91
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-8,295,899.63	-23,633,653.14
资产支持证券投资收益	0.00	0.00
衍生工具收益	-5,912,571.89	-44,202,347.05
股利收益	85,269,777.52	46,506,957.05
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	5,663,315,703.60	-4,529,452,371.92
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		
5.其他收入(损失以"-"号填列)	2,102,919.63	6,668,104.02
二、费用(以"-"号填列)	-194,896,517.21	-271,775,954.75
1.管理人报酬	-108,917,543.94	-149,588,995.92
2.托管费	-18,152,923.98	-24,931,499.28
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	-67,052,134.97	-88,474,029.49
5.利息支出	-539,721.62	-8,544,713.26
其中:卖出回购金融资产支出	-539,721.62	-8,544,713.26
6.其他费用	-234,192.70	-236,716.80
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	5,248,905,853.48	-8,272,993,952.59
所得税费用(以"-"号填列)	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	5,248,905,853.48	-8,272,993,952.59

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:融通新蓝筹证券投资基金

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)	21,361,657,384.55	-8,658,976,413.60	12,702,680,970.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,248,905,853.48	5,248,905,853.48
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)	-783,413,667.62	220,536,694.62	-562,876,973.00
其中:1.基金申购款	599,189,281.37	-137,317,780.04	461,871,501.33
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-1,382,602,948.99	357,854,474.66	-1,024,748,474.33
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-	0.00	0.00
五、期末所有者权益(基金净值)	20,578,243,716.93	-3,189,533,865.50	17,388,709,851.43

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)	24,415,808,414.91	1,908,176,398.58	26,323,984,813.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-8,272,993,952.59	-8,272,993,952.59
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)	-2,311,421,359.07	45,460,159.13	-2,265,961,199.94
其中:1.基金申购款	1,142,686,838.76	-66,950,318.83	1,075,736,519.93
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-3,454,108,197.83	112,410,477.96	-3,341,697,719.87
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-	0.00	0.00
五、期末所有者权益(基金净值)	22,104,387,055.84	-6,319,357,394.88	15,785,029,660.96

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
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	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")	基金管理人股东、基金销售机构

注:以下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	2,197,450,443.99	4.98%	1,599,177,288.50	6.12%

6.4.3.1.2 债券交易

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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
新时代证券	24,727,065.02	6.67%	-	-

6.4.3.1.3 权证交易

本基金本报告期及上年度同期均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.3.1.4 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	1,867,834.19	5.05%	1,176,968.90	7.88%
	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日			
关联方名称	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	1,359,260.98	6.19%	1,359,260.98	14.94%

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	108,917,543.94	149,588,995.92
其中:当期已支付	88,168,510.34	129,427,643.02
期末未支付	20,749,033.60	20,161,352.90

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	18,152,923.98	24,931,499.28
其中:当期已支付	14,694,751.72	21,571,273.80
期末未支付	3,458,172.26	3,360,225.48

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
中国建设银行	0.00	0.00	0.00	0.00	582,000,000.00	210,951.91
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
中国建设银行	0.00	0.00	0.00	0.00	3,369,200,000.00	3,261,196.16

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

本基金的基金管理人本报告期及上年度同期均未投资于本基金。

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
中国建设银行	2,021,900,228.23	5,509,939.99	2,200,652,436.31	11,285,852.76

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
600169	太原重工	2008-12-29	2009-12-29	非公开发行流通受限	12.67	10.78	4,800,000	38,010,000.00	51,744,000.00
600583	海油工程	2008-12-31	2009-12-31	非公开发行流通受限	11.55	9.68	4,950,000	38,115,000.00	47,916,000.00

注:(1)本基金于2008年12月29日认购太原重工非公开发行股票,认购数量3,000,000.00股;2009年5月22日,太原重工实施每10股送4股、转增2股,上表中的数量为送股和转增实施后的总股数;

(2)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3,300,000.00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;

(3)除上述股票外,本基金于本报告期末无其他因认购新发/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

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
000792	盐湖钾肥	2009-6-26	重大资产重组	55.14	2009-7-27	60.65	12,044,464	658,771,735.00	664,131,744.96

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未持有因从事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	10,847,699,491.07	61.72
	其中:股票	10,847,699,491.07	61.72
2	固定收益投资	4,553,631,517.20	25.91
	其中:债券	4,553,631,517.20	25.91
	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	2,055,015,921.60	11.69
6	其他资产	118,287,062.22	0.67
7	合计	17,574,633,992.09	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	124,200.00	0.00
B	采掘业	1,983,892,285.28	11.41
C	制造业	2,870,669,211.60	16.51
C0	食品、饮料	148,100.00	0.00
C1	纺织、服装、皮毛	1,532,500.00	0.01
C2	木材、家具	128,376,943.73	0.74
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	1,516,101,901.84	8.72
C5	电子	49,200.00	0.00
C6	金属、非金属	120,770.00	0.00
C7	机械、设备、仪表	952,378,386.03	5.48
C8	医药、生物制品	271,961,410.00	1.56
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	137,800.00	0.00
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	15,740.00	0.00
H	批发和零售贸易	99,360.00	0.00
I	金融、保险业	2,642,672,077.39	15.20
J	房地产业	2,114,388,297.30	12.16
K	社会服务业	750,936,116.20	4.32
L	传播与文化产业	46,040,000.00	0.26
M	综合类	438,724,403.30	2.52
合计		10,847,699,491.07	62.38

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	600383	金地集团	64,888,769	1,046,006,956.28	6.02
2	000983	西山煤电	33,155,132	991,338,446.80	5.70
3	000001	深发展A	45,052,063	983,036,014.66	5.65
4	600123	兰花科创	26,756,624	943,706,128.48	5.43
5	000069	华侨城A	35,881,118	749,915,366.20	4.31
6	600000	浦发银行	31,932,773	735,092,434.46	4.23
7	000792	盐湖钾肥	12,044,464	664,131,744.96	3.82
8	000402	金融街	48,003,267	660,524,953.92	3.80
9	600166	福田汽车	44,663,199	591,787,386.75	3.40
10	601166	兴业银行	15,758,210	584,787,173.10	3.36

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	600030	中信证券	1,482,580,272.81	11.67
2	600000	浦发银行	1,194,958,833.98	9.41
3	000001	深发展A	1,190,765,448.40	9.37
4	601318	中国平安	1,016,332,445.11	8.00
5	000983	西山煤电	1,015,545,667.08	7.99
6	600031	三一重工	829,159,548.09	6.53
7	600123	兰花科创	814,028,242.82	6.41
8	600383	金地集团	771,680,983.31	6.07
9	000792	盐湖钾肥	721,972,121.52	5.68
10	601398	工商银行	655,360,032.95	5.16
11	000002	万科A	611,739,885.14	4.82
12	000402	金融街	603,241,977.52	4.75
13	601166	兴业银行	574,595,619.51	4.52
14	601628	中国人寿	498,335,869.06	3.92
15	600348	国阳新能	472,702,648.08	3.72
16	600166	福田汽车	440,686,279.34	3.47
17	600331	宏达股份	404,903,899.24	3.19
18	600016	民生银行	395,401,526.01	3.11
19	600547	山东黄金	394,178,787.69	3.10
20	000009	中国宝安	322,403,785.90	2.54
21	600143	金发科技	298,335,853.63	2.35
22	600036	招商银行	294,906,514.66	2.32
23	601186	中国铁建	290,206,988.86	2.28
24	601601	中国太保	284,347,471.90	2.24
25	000527	美的电器	277,495,742.77	2.18
26	600812	华北制药	273,444,792.99	2.15
27	000069	华侨城A	272,854,963.14	2.15

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	600030	中信证券	1,606,674,916.25	12.65
2	600000	浦发银行	1,097,948,310.05	8.64
3	601318	中