融通深证100指数证券投资基金

2009 第三季度报告

2009年9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
报告送出日期:2009年10月27日

§1 重要提示

报告期间开始日期:2009年07月01日
报告期间结束日期:2009年09月30日

融通通利系列证券投资基金由融通债券投资基金、融通深证100指数证券投资基金和融通蓝筹成长证券投资基金共同构成。本报告为融通通利系列证券投资基金之子基金融通深证100指数证券投资基金(以下简称"本基金")2009年第3季度报告。

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据《融通通利系列证券投资基金基金合同》规定,于2009年10月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

§2 基金产品概况

基金简称	融通深证100指数
交易代码	161604
前端交易代码	161604
后端交易代码	161654
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年09月30日
报告期末基金份额总额	11,087,166,319.55份
投资目标	运用指数化投资方式,通过控制股票投资组合与深证100指数的跟踪误差,力求实现对深证100指数的有效跟踪,谋求分享中国经济的持续、稳定增长和中国证券市场的发展,实现基金资产的长期增长,为投资者带来稳定回报。
投资策略	以非债券资产90%以上的资金对深证100指数的成份股进行股票指数化投资。股票指数化投资部分不得低于基金资产的50%,采用复制法跟踪深证100指数,对于因流动性等原因导致无法完全复制深证100指数的情况,将采用剩余组合替换等方法避免跟踪误差扩大。
业绩比较基准	深证100指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%
风险收益特征	风险和预期收益率接近市场平均水平
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2009年07月01日-2009年09月30日)
1.本期已实现收益	-20,336,036.81
2.本期利润	-339,730,260.96
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0330
4.期末基金资产净值	14,376,695,511.25
5.期末基金份额净值	1.297

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、本报告所列示的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 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	-1.52%	2.37%	-1.20%	2.39%	-0.32%	-0.02%

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:1、上表中基金业绩比较基准项目分段计算,其中:2005年8月21日之前(含此日)采用"75%×深证100指数+25%×银行间债券综合指数",2005年8月22日起使用新基准即"深证100指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%"。

2、按基金合同规定,本基金自基金合同生效日起6个月为建仓期,至建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
郑毅	本基金的基金经理、融通巨潮100指数基金(LOF)基金经理。	2009年05月15日	-	17	研究生学历,具有证券从业资格。1992年至1995年,任中国银行深圳国际信托咨询公司证券部经理;1995年至1997年,任中银国际(香港)公司投资银行部经理;1997年至1999年,任特区证券投资银行总部副总经理;1999年至2008年,就职于鹏华基金管理有限公司,其中2001年9月至2003年4月任基金普润基金经理,后任投资总部副总经理职务;2008年至今,任融通基金管理有限公司固定收益小组副组长。
王建强	本基金的基金经理、融通巨潮100指数基金(LOF)基金经理。	2009年05月15日	-	5	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。

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、《融通通利系列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 公平交易专项说明

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

本基金管理人旗下没有与本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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

在严格遵守基金合同的前提下实现持有人利益的最大化是本基金管理的核心思想,并将此原则贯彻于基金的运作之中。本基金运用指数化投资方式,竭力通过控制股票投资权重与深证100指数成份股自然权重的偏离,减少基金相对深证100指数的跟踪误差,力求最终实现对深证100指数的有效跟踪。

2009年第三季度整体来看市场小幅下跌,但是期间波动剧烈:第一阶段为整个7月份,过度乐观的预期将市场估值水平推升到较高位置;第二阶段从8月份开始,随着宏观经济数据低于原来的乐观预期以及货币信贷方面逐步释放的一些收缩信号,证券市场过度乐观的预期无法获得支撑,进入较大幅度的振荡调整阶段。从行业类指数的表现来看:房地产行业指数下跌13.03%、金融子行业指数下跌9.39%、钢铁行业指数下跌8.95%;而医药行业指数上涨10.14%、信息设备行业指数上涨9.29%、交运设备行业指数上涨9.11%以上。从风格类指数的表现来看:新股、低价股、低市盈率、低市净率股票指数下跌超过8%;只有小盘指数上涨3.24%。由于深证100指数中食品饮料、信息设备、汽车、化工等行业占比相对其他指数较高的特点,深证100指数在2009年第三季度下跌1.38%,较其它跨市场指数及大盘指数跌幅稍小,同期深证100指数基金净值下跌1.52%。

我们在第二季度季报和基金半年报中已经充分提示了市场的短期风险,主要原因是我们认为投资者的乐观情绪所影响的股价已经超越了经济和上市公司基本面所能反映的合理收益预期。我们继续维持中国经济在寻找新增长模式和城市化进入第二阶段的看法,对于未来十年的预期,我们认为从工作、生活和经济活动的重心来看,整个中国社会都有可能面临巨大的变化。一方面我们坚信城市化第二阶段的增长潜力不可抑制;但同时我们也认为由于受到经济发展过程中软硬方面的约束,实际经济增长的速度往往不如证券市场的乐观预期,我们提醒投资者应该在市场弥漫着过于乐观的预期时保持警惕,同时如果市场宠罩在过分悲观的预期下,我们认为是较好的投资时机。从当前证券市场估值水平所反映的投资者预期来看,我们认为基本上和实际上市公司的业绩增长水平相适应,在这个时候投资,应该更加关注长期增长受益,短期无重大风险因素的行业和企业。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	13,479,102,414.49	93.10
	其中:股票	13,479,102,414.49	93.10
2	固定收益投资	294,820,000.00	2.04
	其中:债券	294,820,000.00	2.04
	资产支持证券	0.00	0.00
3	金融衍生品投资	0.00	0.00
4	买入返售金融资产	0.00	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	609,227,694.79	4.21
6	其他资产	94,706,144.65	0.65
7	合计	14,477,856,253.93	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 指数投资部分

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	0.00	0.00
B	采掘业	734,989,615.63	5.11
C	制造业	7,150,554,621.61	49.74
C0	食品、饮料	1,094,582,042.13	7.61
C1	纺织、服装、皮毛	56,000,477.85	0.39
C2	木材、家具	0.00	0.00
C3	造纸、印刷	68,765,902.00	0.48
C4	石油、化学、塑胶、塑料	641,886,139.35	4.46
C5	电子	127,746,037.12	0.89
C6	金属、非金属	2,048,917,937.71	14.25
C7	机械、设备、仪表	2,262,312,558.68	15.74
C8	医药、生物制品	780,327,006.07	5.43
C99	其他制造业	70,016,520.70	0.49
D	电力、煤气及水的生产和供应业	250,615,449.72	1.74
E	建筑业	64,348,371.78	0.45
F	交通运输、仓储业	218,663,606.58	1.52
G	信息技术业	565,524,934.28	3.93
H	批发和零售贸易	594,342,484.87	4.13
I	金融、保险业	1,303,063,229.27	9.06
J	房地产业	1,938,937,812.48	13.49
K	社会服务业	378,511,379.69	2.63
L	传播与文化产业	72,353,419.68	0.50
M	综合类	207,197,488.90	1.44
	合计	13,479,102,414.49	93.76

5.2.2 积极投资部分

本基金本报告期未无积极投资部分股票。

5.3 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

5.3.1 指数投资部分

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	000002	万 科A	102,137,903	1,064,276,949.26	7.40
2	000001	深发展A	33,604,274	672,421,522.74	4.68
3	002024	苏宁电器	32,453,314	531,909,816.46	3.70
4	000983	西山煤电	13,862,263	434,027,454.53	3.02
5	000858	五 粮 液	20,737,625	433,623,738.75	3.02

5.3.2 积极投资部分

本基金本报告期未无积极投资部分股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	0.00	0.00
2	央行票据	294,820,000.00	2.05
3	金融债券	0.00	0.00
	其中:政策性金融债	0.00	0.00
4	企业债券	0.00	0.00
5	企业短期融资券	0.00	0.00
6	可转债	0.00	0.00
7	其他	0.00	0.00
8	合计	294,820,000.00	2.05

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0901044	09央行票据44	2,000,000	196,540,000.00	1.37
2	0901042	09央行票据42	1,000,000	98,280,000.00	0.68

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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、处罚的情形:

1、报告期末,本基金所持有的深证100指数成份股中兴通讯数量为10,671,021股,占基金期末资产净值的比例为2.83%。根据中兴通讯股份有限公司董事会2008年10月7日《关于财政部驻深圳市财政监察专员办事处2007年度会计信息质量检查结论和处理决定的公告》,中兴通讯在财政检查中受到16万元的行政罚款并被要求补缴企业所得税380万元。

本基金管理人认为,上述处罚不会对中兴通讯的投资价值构成实质性影响,投资决策程序符合公司投资管理制度的相关规定。

5.8.2 报告期内本基金投资的前十名股票中,无投资于基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,193,226.40
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	0.00
4	应收利息	391,739.49
5	应收申购款	91,121,178.76
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	0.00
8	其他	0.00
9	合计	94,706,144.65

5.8.4 报告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。

5.8.5 期末前五名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.1 指数投资部分

本基金本报告期末指数投资前五名股票中不存在流通受限情况。

5.8.5.2 积极投资部分

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	9,684,504,574.10
报告期间基金总申购份额	4,342,600,361.64
报告期间基金总赎回份额	-2,939,938,616.19
报告期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	0.00
报告期期末基金份额总额	11,087,166,319.55

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准融通通利系列证券投资基金设立的文件;
(二)《融通通利系列证券投资基金基金合同》;
(三)《融通通利系列证券投资基金托管协议》;
(四)《融通通利系列证券投资基金招募说明书》及其更新;
(五)融通基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程;
(六)报告期内在指定报刊上披露的各项公告。

7.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

7.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件,或登陆本基金管理人网站http://www.rtfund.com查询。

融通内需驱动股票型证券投资基金

2009 第三季度报告

2009年9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
报告送出日期:2009年10月27日

§1 重要提示

报告期间开始日期:2009年07月01日
报告期间结束日期:2009年09月30日

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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。

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10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

§2 基金产品概况

基金简称	融通内需驱动股票
交易代码	161611
前端交易代码	161611
后端交易代码	161661
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年04月22日
报告期末基金份额总额	1,182,633,068.69份
投资目标	本基金主要投资于由国内投资需求和消费需求所驱动的优势企业,分享中国经济增长及增长方式转变所带来的收益,实现基金资产可持续的稳定增值。
投资策略	本基金重点投资于由国内投资需求和消费需求所驱动的优势企业,根据经济演进的规律和产业变迁的路径,"自上而下"确定资产配置与行业配置比例,在行业配置下"自下而上"精选个股。本基金股票资产主要投资于治理规范、经营稳健、财务良好和盈利能力强的内需驱动型的优秀公司,但是,只有满足"规范、独特、简单、成长"特性的龙头公司才有可能成为我们的核心资产,对这部分资产,我们将长期持有,充分分享中国经济长期高速增长和企业做大做强所带来的巨大收益。
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	本基金为股票型基金,属于高风险高收益的基金品种,其收益和风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2009年07月01日-2009年09月30日)
1.本期已实现收益	169,105,519.07
2.本期利润	-48,175,184.50
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0329
4.期末基金资产净值	1,216,711,466.32
5.期末基金份额净值	1.029

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)本报告所列示的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 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	-8.21%	2.37%	-3.90%	1.94%	-4.31%	0.43%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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:(1)本基金的合同生效日期为2009年4月22日。

(2)本基金的建仓期为自基金合同生效之日起6个月,截止报告期末,本基金尚在建仓期。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
陈晓生	本基金的基金经理、融通蓝筹成长混合基金的基金经理、融通动力先锋股票基金的基金经理、日兴黄河基金融通模拟组合的组合经理、公司总经理助理	2009年04月22日	-	14	经济学硕士,具有证券从业资格。曾就职于中信集团中大投资管理有限公司,历任证券投资部交易员、期货业务负责人、股票投资经理助理、股票投资经理。2003年2月加入融通基金管理有限公司,历任融通新蓝筹混合基金经理助理、机构理财部投资经理、副总监。
鲁万峰	本基金的基金经理、融通动力先锋股票基金的基金经理	2009年04月22日	-	13	经济学硕士,具有证券从业资格。曾就职于中行深圳国际信托咨询有限公司、北京华融投资管理有限公司和中国人保资产管理有限公司,从事研究和投资工作,2006年6月至今就职于融通基金管理有限公司,任职基金管理部总监助理。
邹曦	本基金的基金经理、融通行业景气混合基金的基金经理	2009年04月22日	-	13	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。

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、《融通内需驱动股票型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 公平交易专项说明

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	-1.64%
融通领先成长股票基金(LOF)	-4.18%
融通动力先锋股票基金	-9.84%
本基金	-8.21%

本基金与融通行业景气混合基金净值增长率的差异为-6.57%,其中-1.90%来自资产配置,-5.11%来自行业配置,-0.56%来自股票选择。1.00%来自其他因素。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未发生异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

1、市场和基金运作回顾

本季度市场出现大幅震荡,8月初沪综指冲高到3478点高位后,在短短的一个月内出现跌幅高达24%的急促回调,沪综指本季度下跌了6.08%,振幅达到28.33%;沪深300指数则下跌了5.11%,振幅为31.82%。

本基金于4月22日成立,本季度基金净值增长率为-8.21%。

三季度房地产、金融等行业如期出现调整,本组合也按计划调低这些行业的配置水平,但本季度基金组合在仓位选择及资产转换上均出现失误,导致组合净值出现大幅度波动。建仓初期,我们较好地把握了地产和金融股的投资机会,净值一度表现理想,但8月份市场进入调整初期时,我们在减持房地产、金融等资产的同时,加仓了钢铁、有色、煤炭等周期性资产,在随后的大调整中这部分资产给组合带来了严重的净值损失,特别是其中的钢铁股。

9月份在市场反弹过程中我们再次调整了组合的结构,降低组合的波动性,并逐步加大中游制造业的配置权重,使组合结构逐渐趋向合理。

2、四季度展望

对于经济前景的迷茫、对流动性收缩的忧虑以及对于二次探底的恐惧引发了三季度的调整,四季度市场将从三季度的混沌中逐步明晰起来,经济数据的良好表现、上市公司业绩增长的如期兑现将给市场提供较强的下档支撑力量,与此同时,刺激政策何时退出、贸易战以及房地产政策是否收紧等担忧仍将继续困扰着市场,估计四季度市场将在振荡中逐步明晰其方向。

从产业层面分析,房地产的兴衰仍然是决定市场方向的关键因素之一,如果10-11月份房地产市场能如期出现销售高峰,那市场将具备创出年内新高的可能,反而如果房价的上涨最终制约了需求,供应量上来了却出现滞销,那对市场将是不小的压力。我们对于房地产行业的龙头企业仍然倾向于相对乐观的判断,象龙头地产公司在四季度获得良好销售业绩的概率较高,当然,我们还需要密切关注政府对于房地产政策的态度变化。

四季度影响市场的另外部分关键因素就是大量的非流通股进入流通市场,创业板的正式推出和即将来临的持续融资压力。工行等大蓝筹大量非流通股的流通给市场带来的压力不会太大,最多只是心理层面;创业板的推出将是四季度市场的一个热点话题,推出初期对于主板的资金分流压力并不大;对于IPO和再融资,压力和机会共存,如果融资量不过分超预期,短期内再融资反而可能成为一个倾向于利好的因素。

从中期看,我们仍然坚持业绩增长较确定的中游制造业更具投资吸引力。在上游原材料成本相对可控、需求旺盛、研发投入持续增长、金融支持等多方有利条件的配合下,中游制造业中部分优势产业比如汽车、家电、通讯设备、工程机械和电力设备等子行业的利润率将获得提升,这些产业中将有部分企业在未来3-5年内成长为既大又强的国际领先型公司。

此外,从刺激内需的角度分析,具有良好带动效应的汽车、家电、通信和医药等产业仍然具有获得更佳相对收益的投资机会。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	903,924,064.85	73.59
	其中:股票	903,924,064.85	73.59
2	固定收益投资	49,155,000.00	4.00
	其中:债券	49,155,000.00	4.00
	资产支持证券	0.00	0.00
3	金融衍生品投资	0.00	0.00
4	买入返售金融资产	0.00	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	271,380,090.58	22.09
6	其他资产	3,921,547.70	0.32
7	合计	1,228,380,703.13	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	0.00	0.00
B	采掘业	12,524,000.00	1.03
C	制造业	380,147,754.29	31.24
C0	食品、饮料	31,787,144.48	2.61
C1	纺织、服装、皮毛	0.00	0.00
C2	木材、家具	0.00	0.00
C3	造纸、印刷	0.00	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	29,646,495.00	2.44
C5	电子	0.00	0.00
C6	金属、非金属	48,612,260.72	4.00
C7	机械、设备、仪表	257,948,054.09	21.20
C8	医药、生物制品	12,153,800.00	1.00
C99	其他制造业	0.00	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00
E	建筑业	0.00	0.00
F	交通运输、仓储业	0.00	0.00
G	信息技术业	27,472,037.20	2.26
H	批发和零售贸易	5,906,161.80	0.49
I	金融、保险业	298,358,482.44	24.52
J	房地产业	112,802,779.12	9.27
K	社会服务业	66,712,850.00	5.48
L	传播与文化产业	0.00	0.00
M	综合类	0.00	0.00
	合计	903,924,064.85	74.29

5.3 报告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

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	601318	中国平安	1,650,000	83,655,000.00	6.88
2	601166	兴业银行	2,000,000	67,580,000.00	5.55
3	000069	华侨城A	3,606,100	66,712,850.00	5.48
4	601628	中国人寿	2,360,000	65,324,800.00	5.37
5	600166	福田汽车	4,150,000	61,544,500.00	5.06
6	600031	三一重工	1,300,000	43,134,000.00	3.55
7	600048	保利地产	1,699,908	41,035,779.12	3.37
8	000001	深发展A	2,000,000	40,020,000.00	3.29
9	000528	柳 工	2,300,000	37,766,000.00	3.10
10	000527	美的电器	2,000,222	34,603,840.60	2.84

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	0.00	0.00
2	央行票据	49,155,000.00	4.04
3	金融债券	0.00	0.00
	其中:政策性金融债	0.00	0.00
4	企业债券	0.00	0.00
5	企业短期融资券	0.00	0.00
6	可转债	0.00	0.00
7	其他	0.00	0.00
8	合计	49,155,000.00	4.04

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0901034	09央行票据34	500,000	49,155,000.00	4.04

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内本基金投资的前十名证券中无发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.2 报告期内本基金投资的前十名股票中,无投资于基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,018,968.43
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	0.00
4	应收利息	157,329.22
5	应收申购款	1,745,250.05
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	0.00
8	其他	0.00
9	合计	3,921,547.70

5.8.4 报告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。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,091,924,658.82
报告期间基金总申购份额	212,005,784.08
报告期间基金总赎回份额	-1,121,297,374.21
报告期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	0.00
报告期期末基金份额总额	1,182,633,068.69

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准融通内需驱动股票型证券投资基金设立的文件;
(二)《融通内需驱动股票型证券投资基金基金合同》;
(三)《融通内需驱动股票型证券投资基金托管协议》;
(四)《融通内需驱动股票型证券投资基金招募说明书》;
(五)融通基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程;
(六)报告期内在指定报刊上披露的各项公告。

7.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

7.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件,或登陆本基金管理人网站http://www.rtfund.com查询。

融通新蓝筹证券投资基金

2009 第三季度报告

2009年9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
报告送出日期:2009年10月27日

§1 重要提示

报告期间开始日期:2009年07月01日
报告期间结束日期:2009年09月30日

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2009年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

§2 基金产品概况

基金简称	融通新蓝筹混合
交易代码	161601
前端交易代码	161601
后端交易代码	161602
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年09月13日
报告期末基金份额总额	19,804,532,184.25份
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%;权证投资比例浮动范围:0%-3%;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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2009年07月01日-2009年09月30日)
1.本期已实现收益	570,459,292.81
2.本期利润	-1,003,132,860.82
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0500
4.期末基金资产净值	15,692,307,900.61
5.期末基金份额净值	0.7924

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、本报告所列示的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 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	-6.22%	2.07%	-2.48%	1.73%	-3.74%	0.34%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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:按基金合同规定,本基金