融通通利系列证券投资基金之融通深证100指数证券投资基金 2009年年度报告摘要

2009年12月31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
送出日期:2010年3月31日

§1 重要提示

1.1 重要提示

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。本年度报告摘要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年年度报告摘要。

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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

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2010年3月25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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告中的财务资料已经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2009年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	融通深证100指数	
基金主代码	161604	
交易代码	161604(前端收费模式)	161654(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	2003年09月30日	
报告期末基金份额总额	12,394,223,828.39份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

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

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	中国工商银行
信息披露负责人	姓名	吴冶平	蒋松云
	联系电话	0755)26948666	010)66105799
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-883-8088、0755)26948088	95588
传真		0755)26935005	010)66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http:/www.rtfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2009年	2008年	2007年
本期已实现收益	-372,957,836.01	-548,188,473.81	3,350,417,932.35
本期利润	7,795,015,526.97	-8,761,175,288.35	5,740,789,914.25
加权平均基金份额本期利润	0.7741	-1.1697	1.0961
本期基金份额净值增长率	103.78%	-60.61%	151.54%
3.1.2 期末数据和指标	2009年末	2008年末	2007年末
期末可供分配基金份额利润	0.0113	-0.2301	0.2993
期末基金资产净值	17,258,104,416.79	6,434,252,259.89	12,369,878,042.75
期末基金份额净值	1.392	0.770	1.955

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)期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配利润: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)。

3.2 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
过去三个月	20.98%	1.74%	21.71%	1.75%	-0.73%	-0.01%
过去六个月	19.14%	2.09%	20.24%	2.11%	-1.10%	-0.02%
过去一年	103.78%	2.02%	107.59%	2.04%	-3.81%	-0.02%
过去三年	101.91%	2.43%	116.96%	2.45%	-15.05%	-0.02%
过去五年	332.16%	2.07%	360.87%	2.07%	-28.71%	0.00%
自基金合同生效起至今	307.22%	1.91%	353.57%	1.91%	-46.35%	0.00%

注:本基金在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"深证100指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%"。本报告中所涉及"业绩比较基准收益率"指标均按变更时间分段计算。

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

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2009	1.800	622,753,930.35	1,354,432,520.69	1,977,186,451.04	-
2008	-	-	-	-	-
2007	7.100	601,130,875.94	1,053,289,212.58	1,654,420,088.52	-
合计	8.900	1,223,884,806.29	2,407,721,733.27	3,631,606,539.56	-

§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12月31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
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5月15日	-	18	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年加入融通基金管理有限公司,曾任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5月15日	-	6	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。
张野	本基金的基金经理、融通巨潮100指数基金(LOF)基金经理。	2003年9月30日	2009年5月14日	14	工商管理硕士,具有证券从业资格。历任杭州新希望证券投资顾问有限公司董事长、总经理,融通基金管理有限公司研究员。

注:任职日期和离任日期均指公司董事会作出决定之日,证券从业年限以从事证券业务相关工作的时间为计算标准。

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 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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。在充裕的流动性和宏观经济复苏的刺激之下,2009年的A股证券市场出现了较大幅度的单边上涨,深证100指数在2009年上涨115.02%。从组成指数的各行业类指数表现来看:交运设备、有色金属、采掘、家用电器、电子元器件、餐饮旅游、信息设备等指数明显超越深证100指数;而建筑建材、公用事业、交通运输等行业指数表现弱于深证100指数。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金份额净值增长率为103.78%,基金业绩比较基准收益率为107.59%。

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2010年证券市场的表现,我们认为将取决于影响市场的几个重大要素的变化及市场预期的影响。我们认为影响市场的重大因素有:宏观调控政策的频度和力度、出口复苏的实际影响、内需带动的投资和消费实际增长情况。由于证券市场的走势往往是市场预期对宏观和微观层面的提前反映,考虑到当前的证券市场供需状况和整体上市公司的业绩增长水平,我们认为2010年将更多的表现为弱势平衡的格局,指数表现出现2009年大幅单边上涨的概率较少。短期内我们较多的关注结构性的机会;但同时,2010年也是为长期经济发展前景下受益的行业和产业布局的阶段。从目前的能见度来看,较为确认的投资机会来自受益于移动互联应用的相关产业、受益于金融改革深化的相关产业、受益于新一轮城市化进程的相关产业。

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,金融工程小组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

本基金管理人于2009年12月15日对基金份额持有人实施了收益分配,以2009年12月3日的可分配收益为基准,每10份基金份额派发现金红利1.80元。

§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,本基金托管人在对融通深证100指数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,融通深证100指数证券投资基金的管理人——融通基金管理有限公司在融通深证100指数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,融通深证100指数证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配,分配金额为1,977,186,451.04元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对融通基金管理有限公司编制和披露的融通深证100指数证券投资基金2009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 审计报告

本基金2009年年度财务会计报告已经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告(普华永道中天审字(2010)第20099号),投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:融通深证100指数证券投资基金

报告截止日:2009年12月31日

单位:人民币元

项目	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
资产:		
银行存款	289,865,219.64	181,716,802.19
结算备付金	2,105,541.65	2,713,870.94
存出保证金	3,483,381.35	2,000,000.00
交易性金融资产	16,980,283,950.88	6,270,431,601.08
其中:股票投资	16,386,513,950.88	6,029,316,601.08
基金投资	-	-
债券投资	593,770,000.00	241,115,000.00
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	-	-
应收利息	2,008,009.27	8,671,181.95
应收股利	-	-
应收申购款	127,473,920.84	19,110,810.55
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	17,405,220,023.63	6,484,644,266.71
负债和所有者权益	本期末 2009年12月31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	-	24,947,351.74
应付赎回款	125,058,248.00	15,320,382.60
应付管理人报酬	14,356,747.16	5,877,109.56
应付托管费	2,871,349.43	1,175,421.90
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,303,607.97	855,868.35
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	2,525,654.28	2,215,872.67
负债合计	147,115,606.84	50,392,006.82
所有者权益:		
实收基金	12,394,223,828.39	8,356,863,312.13
未分配利润	4,863,880,588.40	-1,922,611,052.24
所有者权益合计	17,258,104,416.79	6,434,252,259.89
负债和所有者权益总计	17,405,220,023.63	6,484,644,266.71

注:报告截止日2009年12月31日,基金份额净值1.392元,基金份额总额12,394,223,828.39份。

7.2 利润表

会计主体:融通深证100指数证券投资基金

本报告期:2009年1月1日 至 2009年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
一、收入	7,959,616,974.57	-8,634,924,672.44
1.利息收入	13,192,455.08	13,242,560.43
其中:存款利息收入	3,562,709.20	3,448,732.41
债券利息收入	9,629,745.88	9,793,828.02
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	-228,244,652.27	-438,105,232.00
其中:股票投资收益	-300,120,383.69	-470,349,747.48
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-4,788,700.00	4,630,589.31
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-50,326,815.19
股利收益	76,664,431.42	77,940,741.36
3.公允价值变动收益	8,167,973,362.98	-8,212,986,814.54
4.汇兑收益	-	-
5.其他收入	6,695,808.78	2,924,813.67
减:二、费用	164,601,447.60	126,250,615.91
1.管理人报酬	126,389,167.43	91,046,684.91
2.托管费	25,277,833.48	18,209,337.05
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	12,653,622.58	16,683,851.57
5.利息支出	-	20,820.30
其中:卖出回购金融资产支出	-	20,820.30
6.其他费用	280,824.11	289,922.08
三、利润总额	7,795,015,526.97	-8,761,175,288.35
减:所得税费用	-	-
四、净利润	7,795,015,526.97	-8,761,175,288.35

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:融通深证100指数证券投资基金

本报告期:2009年1月1日 至 2009年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31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)	8,356,863,312.13	-1,922,611,052.24	6,434,252,259.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	7,795,015,526.97	7,795,015,526.97
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	4,037,360,516.26	968,662,564.71	5,006,023,080.97
其中:1.基金申购款	14,973,946,020.19	4,077,413,199.95	19,051,359,220.14
2.基金赎回款	-10,936,585,503.93	-3,108,750,635.24	-14,045,336,139.17
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-1,977,186,451.04	-1,977,186,451.04
五、期末所有者权益(基金净值)	12,394,223,828.39	4,863,880,588.40	17,258,104,416.79
项目	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31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)	6,326,455,507.03	6,043,422,535.72	12,369,878,042.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-8,761,175,288.35	-8,761,175,288.35
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	2,030,407,805.10	795,141,700.39	2,825,549,505.49
其中:1.基金申购款	7,061,711,810.09	2,104,595,001.44	9,166,306,811.53
2.基金赎回款	-5,031,304,004.99	-1,309,453,301.05	-6,340,757,306.04
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	8,356,863,312.13	-1,922,611,052.24	6,434,252,259.89

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:秦玮 主管会计工作负责人:周学东 会计机构负责人:刘美丽

7.4 报表附注

7.4.1 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相一致。

7.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错和更正金额。

7.4.3 关联方关系

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
中国工商银行	基金托管人、基金代销机构
新时代证券有限责任公司(暂时代证券")	基金管理人股东、基金代销机构
日兴资产管理有限公司	基金管理人股东

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。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未租用关联方的交易单元。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	126,389,167.43	91,046,684.91
其中:支付销售机构的客户维护费	15,225,244.19	10,604,836.08

注:支付基金管理人融通基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值1.00%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:日基金管理费=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	25,277,833.48	18,209,337.05

注:支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.20%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:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

7.4.4.3 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均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度本基金管理人未投资于本基金。

7.4.4.4.2 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投资于本基金。

7.4.4.5 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12月31日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31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	289,865,219.64	3,232,851.86	181,716,802.19	3,305,056.88

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。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金本报告期和上年度均未买入管理人、托管人的控股股东在承销期内担任副主承销商或分销商所承销的证券;

2、本基金本报告期和上年度均未买入管理人、托管人的主要股东(非控股)在承销期承销的股票。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.5 期末(2009年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 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

7.4.5.1.1 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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000100	TCL集团	2009年04月27日	2010年04月27日	非公开发行	2.58	4.35	10,000,000	25,800,000.00	43,500,000.00	-

注:1、本基金本期末未持有其他类别的认购新发/增发证券而流通受限证券。

2、基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外,基金还可作为特定投资者,认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规定的非公开发行股票,所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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	备注
000623	吉林敖东	2009年12月28日	公布重大事项	49.19	2010年01月11日	54.11	6,003,792	279,899,366.90	295,326,528.48	-
000709	唐钢股份	2009年12月16日	资产重组	7.09	2010年01月25日	6.60	20,280,934	200,337,734.09	143,791,822.06	复牌后更名为河北钢铁

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末,本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末,本基金无交易所债券正回购交易中作为抵押的债券。

§8 投资组合报告

8.1 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	16,386,513,950.88	94.15
	其中:股票	16,386,513,950.88	94.15
2	固定收益投资	593,770,000.00	3.41
	其中:债券	593,770,000.00	3.41
	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	291,970,761.29	1.68
6	其他各项资产	132,965,311.46	0.76
7	合计	17,405,220,023.63	100.00

8.2 期末按行业分类的股票指数投资组合

8.2.1 指数投资部分

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	1,121,401,367.52	6.50
C	制造业	8,775,586,255.02	50.85
C0	食品、饮料	1,484,158,505.99	8.60
C1	纺织、服装、皮毛	65,806,706.00	0.38
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	180,509,964.60	1.04
C4	石油、化学、塑胶、塑料	706,477,107.19	4.09
C5	电子	179,945,128.02	1.04
C6	金属、非金属	2,346,426,793.40	13.60
C7	机械、设备、仪表	2,743,055,475.28	15.89
C8	医药、生物制品	987,531,631.06	5.72
C99	其他制造业	81,674,943.48	0.47
D	电力、煤气及水的生产和供应业	289,562,988.48	1.68
E	建筑业	72,335,600.04	0.42
F	交通运输、仓储业	332,172,425.59	1.92
G	信息技术业	689,411,531.51	4.00
H	批发和零售贸易	727,205,968.64	4.21
I	金融、保险业	1,713,933,286.65	9.93
J	房地产业	1,970,662,634.98	11.42
K	社会服务业	360,998,216.99	2.09
L	传播与文化产业	69,957,009.74	0.41
M	综合类	263,286,665.72	1.53
	合计	16,386,513,950.88	94.95

8.2.2 积极投资部分本基金本报告期末无积极投资部分股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

8.3.1 指数投资部分前十名

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	000002	万 科A	99,575,114	1,076,406,982.34	6.24
2	000001	深发展A	31,847,665	776,127,596.05	4.50
3	000858	五 粮 液	20,635,683	653,325,723.78	3.79
4	002024	苏宁电器	31,090,904	646,068,985.12	3.74
5	000983	西山煤电	13,693,308	546,226,056.12	3.17
6	000063	中兴通讯	10,509,088	471,542,778.56	2.73
7	000651	格力电器	15,624,968	452,186,573.92	2.62
8	000527	美的电器	13,791,395	319,960,364.00	1.85
9	000568	泸州老窖	7,920,799	309,227,992.96	1.79
10	000623	吉林敖东	6,003,792	295,326,528.48	1.71

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)的年度报告正文。

8.3.2 积极投资部分前五名

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	000002	万 科A	334,276,089.39	5.20
2	000001	深发展A	240,142,417.84	3.73
3	000629	攀钢钒钛	203,139,217.18	3.16
4	002202	金风科技	199,740,840.50	3.10
5	002024	苏宁电器	166,368,728.81	2.59
6	000063	中兴通讯	156,888,343.72	2.44
7	000728	国元证券	147,563,291.80	2.29
8	000783	长江证券	145,629,322.67	2.26
9	000858	五 粮 液	142,756,792.52	2.22
10	000983	西山煤电	134,064,774.36	2.08
11	000651	格力电器	115,652,214.81	1.80
12	000792	盐湖钾肥	111,897,930.11	1.74
13	000402	金 融 街	101,245,722.23	1.57
14	000718	苏宁环球	100,068,457.26	1.56
15	002155	辰州矿业	93,195,581.27	1.45
16	000623	吉林敖东	92,183,696.00	1.43
17	000024	招商地产	78,443,898.93	1.22
18	000527	美的电器	78,008,531.58	1.21
19	000568	泸州老窖	77,347,761.12	1.20
20	000999	三九医药	77,044,119.69	1.20

注:"买入金额"是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。

8.4.2 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	000629	攀钢钒钛	378,227,175.35	5.88
2	000002	万 科A	183,112,252.61	2.85
3	000063	中兴通讯	168,320,922.41	2.62
4	002024	苏宁电器	136,836,126.35	2.13
5	000001	深发展A	103,043,191.59	1.60
6	000937	冀中能源	97,124,095.27	1.51
7	000858	五 粮 液	84,606,903.68	1.31
8	000983	西山煤电	71,997,836.68	1.12
9	000069	华侨城A	69,230,840.90	1.08
10	002048	宁波华翔	65,985,085.39	1.03
11	000831	关铝股份	63,638,029.22	0.99
12	002142	宁波银行	57,242,210.05	0.89
13	002128	露天煤业	55,996,081.45	0.87
14	000568	泸州老窖	53,840,786.62	0.84
15	000898	鞍钢股份	51,714,403.95	0.80
16	000157	中联重科	50,072,995.45	0.78
17	000825	太钢不锈	49,840,178.06	0.77
18	000707	双环科技	49,736,841.93	0.77
19	000623	吉林敖东	46,493,291.18	0.72
20	000527	美的电器	45,901,933.83	0.71

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。

8.4.3 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	5,904,468,956.19
卖出股票收入(成交)总额	3,415,925,385.68

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