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 2010年半年度报告摘要

2010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:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2010年8月27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")2010年半年度报告摘要。

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8月23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2010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(以下简称"中国工商银行")	
报告期末基金份额总额	12,977,293,024.98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	中国工商银行股份有限公司
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	基金管理人处、基金托管人处

§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(2010年1月1日至2010年6月30日)
本期已实现收益	-58,878,340.40
本期利润	-4,822,459,298.94
加权平均基金份额本期利润	-0.3823
本期基金份额净值增长率	-27.44%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2010年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0068
期末基金资产净值	13,106,616,187.52
期末基金份额净值	1.010

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
过去一个月	-8.43%	1.73%	-8.37%	1.76%	-0.06%	-0.03%
过去三个月	-22.84%	1.87%	-22.75%	1.89%	-0.09%	-0.02%
过去六个月	-27.44%	1.61%	-27.28%	1.63%	-0.16%	-0.02%
过去一年	-13.56%	1.88%	-12.56%	1.90%	-1.00%	-0.02%
过去三年	-21.06%	2.31%	-19.76%	2.33%	-1.30%	-0.02%
自基金合同生效起至今	195.47%	1.89%	229.84%	1.89%	-34.37%	0.00%

注:本报告中的基金业绩比较基准表现分段计算,其中:2005年8月21日(含此日)之前采用"深证100指数×75%+银行间债券综合指数×25%",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%"。

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

§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2010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		
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。
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	2010年4月17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。

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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

在货币政策趋紧流动性收缩以及2009年刺激政策对经济增长效应逐渐降低的情况下,2010上半年的A股证券市场出现了较大幅度的下跌,深证100指数在2010年上半年下跌28.57%。从组成指数的各行业类指数表现来看:医药生物、电子元器件、餐饮旅游、纺织服装等行业跌幅明显少于深证100指数;而黑色金属、采掘、房地产、化工等行业跌幅超过深证100指数。同期本基金净值下跌27.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2010年下半年证券市场的表现,将取决于影响市场的三个重大要素的变化及市场预期之间的相互作用。这些要素是:房地产市场及宏观调控政策持续性;出口收缩的实际影响;转变增长结构对居民实际收入和消费的影响。证券市场从4月中旬以来的走势已经反映了资本市场参与者对于房地产市场及宏观调控政策所产生的负面效果的预期以及部分经济增长下降的预期,但真正决定长期趋势的是经济增长结构究竟能否成功转变。在下半年,这些主要的因素和一些短期的政策或者舆论的扰动将会使市场形势纠结,作为长期投资者,等待经济增长下降可能带来的进一步系统风险释放之后或者经济结构转变出现明显趋势时可能是更加稳妥的策略。从目前的能见度来看,选择增长稳定,估值不高的消费类资产拥有较高的安全性。

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

本基金本报告期末进行利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。

§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

2010年上半年,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

2010年上半年,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指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对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2010年半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:融通深证100指数证券投资基金

报告截止日:2010年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2010年6月30日	上年度末 2009年12月31日
资产:		
银行存款	478,487,508.10	289,865,219.64
结算备付金	4,460,779.84	2,105,541.65
存出保证金	2,000,000.00	3,483,381.35
交易性金融资产	12,776,851,098.99	16,980,283,950.88
其中:股票投资	12,185,161,098.99	16,386,513,950.88
基金投资	-	-
债券投资	591,690,000.00	593,770,000.00
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	6,553,984.04	2,008,009.27
应收股利	-	-
应收申购款	57,065,527.86	127,473,920.84
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	13,325,418,898.83	17,405,220,023.63
负债和所有者权益	本期末 2010年6月30日	上年度末 2009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	182,454,856.34	-
应付赎回款	18,898,147.28	125,058,248.00
应付管理人报酬	11,611,450.85	14,356,747.16
应付托管费	2,322,290.13	2,871,349.43
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,304,513.35	2,303,607.97
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	2,211,453.36	2,525,654.28
负债合计	218,802,711.31	147,115,606.84
所有者权益:		
实收基金	12,977,293,024.98	12,394,223,828.39
未分配利润	129,323,162.54	4,863,880,588.40
所有者权益合计	13,106,616,187.52	17,258,104,416.79
负债和所有者权益总计	13,325,418,898.83	17,405,220,023.63

注:报告截止日2010年6月30日,基金份额净值1.010元,基金份额总额12,977,293,024.98份。

6.2 利润表

会计主体:融通深证100指数证券投资基金

本报告期:2010年1月1日至2010年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日
一、收入	-4,725,965,682.16	5,111,579,508.75
1.利息收入	6,152,069.11	6,588,819.03
其中:存款利息收入	1,199,977.53	1,297,650.61
债券利息收入	4,905,888.30	5,291,168.42
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	46,203.28	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益	29,278,428.89	-371,524,226.46
其中:股票投资收益	-41,513,410.24	-432,251,113.96
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-114,000.00
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	70,791,839.13	60,840,887.50
3.公允价值变动收益	-4,763,580,958.54	5,473,917,550.77
4.汇兑收益	-	-
5.其他收入	2,184,778.38	2,597,365.41
减:二、费用	96,493,616.78	64,309,560.57
1.管理人报酬	77,337,420.52	48,580,372.53
2.托管费	15,467,484.05	9,716,074.54
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	3,543,947.44	5,873,965.76
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	144,764.77	139,147.74
三、利润总额	-4,822,459,298.94	5,047,269,948.18
减:所得税费用	-	-
四、净利润	-4,822,459,298.94	5,047,269,948.18

6.3 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:2010年1月1日至2010年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010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)	12,394,223,828.39	4,863,880,588.40	17,258,104,416.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-4,822,459,298.94	-4,822,459,298.94
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	583,069,196.59	87,901,873.08	670,971,069.67
其中:1.基金申购款	3,958,478,716.61	1,002,824,676.65	4,961,303,393.26
2.基金赎回款	-3,375,409,520.02	-914,922,803.57	-4,290,332,323.59
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)	12,977,293,024.98	129,323,162.54	13,106,616,187.52
项目	上年度可比期间 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)	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)	-	5,047,269,948.18	5,047,269,948.18
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	1,327,641,261.97	-57,026,851.30	1,270,614,410.67
其中:1.基金申购款	6,419,744,620.64	395,470,488.06	6,815,215,108.70
2.基金赎回款	-5,092,103,358.67	-452,497,339.36	-5,544,600,698.03
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)	9,684,504,574.10	3,067,632,044.64	12,752,136,618.74

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

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

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

本基金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 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 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
中国工商银行	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。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	77,337,420.52	48,580,372.53
其中:支付给销售机构的客户维护费	9,679,498.24	5,777,860.54

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。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	15,467,484.05	9,716,074.54

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。

6.4.4.3 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可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间本基金管理人未投资于本基金。

6.4.4.4.2 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。

6.4.4.5 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 2010年1月1日至2010年6月30日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009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
中国工商银行	478,487,508.10	1,034,105.46	368,792,021.75	1,182,310.31

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。

6.4.4.6 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可比期间均未买入管理人、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可比期间均未买入管理人、托管人的主要股东(非控股)在承销期承销的股票。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.5 期末(2010年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

6.4.5.2 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
000001	深发展A	2010-6-30	重大资产重组	17.51	-	-	33,108,807	595,574,750.26	579,735,210.57	-
000895	双汇发展	2010-3-22	重大资产重组	43.59	-	-	3,604,190	150,528,408.80	157,106,642.10	-

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

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。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

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。

§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	12,185,161,098.99	91.44
	其中:股票	12,185,161,098.99	91.44
2	固定收益投资	591,690,000.00	4.44
	其中:债券	591,690,000.00	4.44
	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	482,948,287.94	3.62
6	其他各项资产	65,619,511.90	0.49
7	合计	13,325,418,898.83	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	41,321,804.20	0.32
B	采掘业	748,169,329.65	5.71
C	制造业	6,798,133,904.41	51.87
C0	食品、饮料	1,238,781,706.61	9.45
C1	纺织、服装、皮毛	46,349,473.74	0.35
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	168,365,966.04	1.28
C4	石油、化学、塑胶、塑料	496,454,402.78	3.79
C5	电子	156,662,884.91	1.20
C6	金属、非金属	1,542,635,061.66	11.77
C7	机械、设备、仪表	2,104,911,038.15	16.06
C8	医药、生物制品	957,512,882.80	7.31
C99	其他制造业	86,460,487.72	0.66
D	电力、煤气及水的生产和供应业	194,275,892.50	1.48
E	建筑业	55,691,523.84	0.42
F	交通运输、仓储业	112,689,889.22	0.86
G	信息技术业	561,157,325.91	4.28
H	批发和零售贸易	695,098,138.94	5.30
I	金融、保险业	1,151,333,924.55	8.78
J	房地产业	1,276,353,479.07	9.74
K	社会服务业	189,025,782.00	1.44
L	传播与文化产业	63,756,742.12	0.49
M	综合类	298,153,362.58	2.27
	合计	12,185,161,098.99	92.97

7.2.2 积极投资部分

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

7.3 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

7.3.1 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	104,453,413	708,194,140.14	5.40
2	000001	深发展A	33,108,807	579,735,210.57	4.42
3	002024	苏宁电器	48,007,626	547,286,936.40	4.18
4	000858	五粮液	21,536,457	521,828,353.11	3.98
5	000983	西山煤电	18,502,312	336,001,985.92	2.56
6	000063	中兴通讯	16,849,234	324,179,262.16	2.47
7	000651	格力电器	16,360,960	307,586,048.00	2.35
8	000527	美的电器	21,677,523	247,123,762.20	1.89
9	000568	泸州老窖	8,362,830	235,999,062.60	1.80
10	000423	东阿阿胶	6,380,494	221,785,971.44	1.69

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。

7.3.2 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。

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	000709	河北钢铁	147,334,343.81	0.85
2	000002	万科A	83,970,315.59	0.49
3	000858	五粮液	52,492,326.30	0.30
4	000001	深发展A	51,790,003.72	0.30
5	000829	天音控股	49,888,849.96	0.29
6	000983	西山煤电	47,691,975.62	0.28
7	000063	中兴通讯	41,321,084.24	0.24
8	002069	獐子岛	40,900,229.40	0.24
9	000786	北新建材	39,254,072.74	0.23
10	000066	长城电脑	39,223,459.64	0.23
11	000522	白云山A	38,444,686.36	0.22
12	002024	苏宁电器	35,607,786.09	0.21
13	002078	太阳纸业	34,793,354.15	0.20
14	000651	格力电器	31,476,442.91	0.18
15	000069	华侨城A	28,126,067.64	0.16
16	002202	金风科技	24,881,643.15	0.14
17	002092	中泰化学	24,226,918.77	0.14
18	000568	泸州老窖	23,351,114.30	0.14
19	000527	美的电器	23,158,288.32	0.13
20	000927	一汽夏利	23,140,478.81	0.13

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。

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	000581	威孚高科	65,145,580.72	0.38
2	000046	泛海建设	54,213,594.26	0.31
3	000002	万科A	50,818,657.08	0.29
4	000959	首钢股份	49,376,232.09	0.29
5	000089	深圳机场	47,509,975.51	0.28
6	000006	深振业A	43,539,832.05	0.25
7	000858	五粮液	31,080,139.02	0.18
8	000532	力合股份	30,313,200.66	0.18
9	000001	深发展A	29,398,920.03	0.17
10	000983	西山煤电	28,827,108.91	0.17
11	000952	广济药业	28,526,958.92	0.17
12	002024	苏宁电器	20,112,050.53	0.12
13	000651	格力电器	16,062,315.97	0.09
14	002092	中泰化学	14,041,473.71	0.08
15	000063	中兴通讯	13,498,639.69	0.08
16	000069	华侨城A	13,282,029.61	0.08
17	000402	金融街	12,291,132.30	0.07
18	000667	名流置业	11,785,325.91	0.07
19	000825	太钢不锈	11,706,388.53	0.07
20	000783	长江证券	11,706,160.46	0.07

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	1,585,453,084.45
卖出股票收入(成交)总额	982,473,567.56

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	591,690,000.00	4.51
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	591,690,000.00	4.51

7.6 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	0901044	09央行票据44	2,000,000	196,300,000.00	1.50
2	1001021	10央行票据21	2,000,000	195,680,000.00	1.49
3	0801029	08央行票据29	1,000,000	101,550,000.00	0.77
4	0901042	09央行票据42	1,000,000	98,160,000.00	0.75

7.7 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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内没有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。

7.9.2 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,000,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,553,984.04
5	应收申购款	57,065,527.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	65,619,511.90

7.9.4 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。

7.9.5 期末投资存在流通受限情况的说明

7.9.5.1 指数投资部分前十名股票

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000001	深发展A	579,735,210.57	4.42	重大资产重组

7.9.5.2 积极投资部分前五名股票

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,044,969	12,418.83	105,902,934.93	0.82%	12,871,390,090.05	99.18%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	1,655,292.48	0.0128%

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2003年9月30日)基金份额总额	477,689,377.16
本报告期期初基金份额总额	12,394,223,828.39
本报告期基金总申购份额	3,958,478,716.61
减:本报告期基金总赎回份额	3,375,409,520.02
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	12,977,293,024.98

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大变动

(1)经公司董事会审议通过,同意孟立坤先生辞去公司董事长职务。

具体内容请参阅2010年3月15日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上刊登的公告。

(2)经公司董事会审议通过,同意吕秋梅女士辞去公司总经理职务,并决定由公司副总经理秦玮先生代为履行公司总经理职务。

具体内容请参阅2010年3月15日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上刊登的公告。

(3)经公司研究决定,同意郑毅先生辞去本基金的基金经理职务。

具体内容请参阅2010年4月17日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上刊登的公告。

(4)经公司董事会审议并经中国证监会核准,选举田德军先生担任公司董事长职务。

具体内容请参阅2010年5月22日在《证券时报》上刊登的公告。

10.2.2 本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

在本报告期内没有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金的投资策略未发生变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所,仍为普华永道中天会计师事务所有限公司。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人、托管人及其高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	1,353,648,371.29	52.89%	1,099,845.71	52.89%	-
长江证券	1	730,244,745.02	28.53%	593,330.33	28.53%	-
长城证券	1	475,574,294.88	18.58%	386,406.80	18.58%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰联合证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信万通证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注:1、券商选择标准。公司在选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构时,禁止将席位开设与证券经营机构的基金销售挂钩,禁止以任何形式向证券经营机构承诺基金在席位上的交易量。具体选择标准包括以下几个方面:

(1)实力雄厚,信誉良好;内部管理规范,严格;注册资本符合证监会相关要求;

(2)研究实力较强,有稳定的研究机构和专业的研究人员,能及时为本公司提供高质量的研究支持与服务,包括宏观与策略报告、行业与公司分析报告、债券市场分析报告、金融衍生品分析报告,并能根据基金投资的特定要求,提供专门研究报告;

(3)券商利用其他专业研究咨询机构为公司提供研究与支持服务的,对该券商研究方面的要求参照上述第2条规定。

2、选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的程序包括以下四个步骤:

(1)券商服务评价;

(2)拟定租用对象。由研究部根据以上评价结果拟定备选的券商;

(3)上报批准。研究部将拟定租用对象上报分管副总经理批准;

(4)签约。在获得批准后,按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

3、本报告期内基金租用交易单元无变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

融通基金管理有限公司
二〇一〇年八月二十七日