融通新蓝筹证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011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：2011 年 8 月 25 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 2011 年 8 月 19 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 2011 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	融通新蓝筹混合	
基金主代码	161601	
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	
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	
报告期末基金份额总额	15,904,370,697.90 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	沪深 300 指数收益率×75%+中信标普全债指数收益率×25%。
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	涂卫东	尹东
	联系电话	(0755)26948666	(010)67595003
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	yindong.zh@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	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（2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-177,842,647.66
本期利润	-1,576,795,152.81
加权平均基金份额本期利润	-0.0965
本期基金份额净值增长率	-11.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2011 年 6 月 30 日）
期末可供分配基金份额利润	-0.2451
期末基金资产净值	12,372,469,088.73
期末基金份额净值	0.7779

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）。

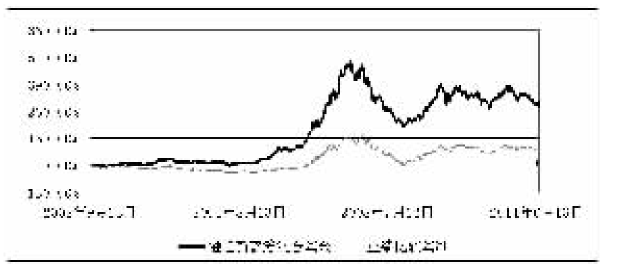
3.2 基金净值表现

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	1.75%	0.90%	1.05%	0.90%	0.70%	0.00%
过去三个月	-5.77%	0.80%	-4.01%	0.83%	-1.76%	-0.03%
过去六个月	-11.04%	0.88%	-1.54%	0.93%	-9.50%	-0.05%
过去一年	6.04%	1.06%	14.39%	1.06%	-8.35%	0.00%
过去三年	8.93%	1.28%	20.19%	1.50%	-11.26%	-0.22%
自基金合同生效起至今	304.22%	1.26%	78.61%	1.38%	225.61%	-0.12%

注：本报告中的基金业绩比较基准表现分段计算，其中 2009 年 12 月 31 日之前（含此日）采用"国泰君安指数×75%+银行间债券综合指数×25%"，2010 年 1 月 1 日起使用新基准即"沪深 300 指数收益率×75%+中信标普全债指数收益率×25%"。

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 2011 年 6 月 30 日，公司管理的基金共有十二只：一只封闭式基金，既融通通乾封闭基金；十一只开放式基金，既融通新蓝筹混合基金、融通债券基金、融通深证 100 指数基金、融通蓝筹成长混合基金、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）、融通内需驱动股票基金和融通深证成份指数基金。其中融通债券基金、融通深证 100 指数基金和融通蓝筹成长混合基金同属融通通利系列证券投资基金。此外，公司还开展了特定客户资产管理业务。

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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴巍	本基金的基金经理、基金管理部执行总监	2011年 4 月 6 日	-	18	硕士学位，具有证券从业资格。自 1993 年 7 月起，先后任职珠海丽珠医药集团公司药品开发工程师、中旅信证券深圳研究所行业研究员、深圳市至善投资有限公司行业研究员、宝盈基金管理有限公司行业研究员，2003 年 12 月进入融通基金管理有限公司，先后任行业研究员、研究部总监、基金管理部执行总监。
汪忠远	本基金的基金经理	2010年 4 月 23 日	-	15	研究生学历，具有证券从业资格。毕业于曼彻斯特大学商学院。1993 年至 1997 年，任职君安证券武汉营业部投资经理；1997 年至 1999 年，任职延宁发展有限公司证券投资部经理；2001 年至 2005 年，任职深圳林奇投资顾问有限公司投资经理；2006 年加入融通基金管理有限公司，任机构理财部投资经理助理。
刘模林	本基金的基金经理、公司副总经理	2004年 7 月 21 日	2011年 4 月 6 日	17	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。
张敏	本基金的基金经理	2009年 8 月 26 日	2011 年 3 月 24 日	7	毕业于南开大学金融工程学院，金融学硕士，具有证券从业资格。2005 年 2 月至 2006 年 1 月，任中国国际期货有限公司行业研究员；2006 年 2 月至 2006 年 12 月，任摩根士丹利华鑫基金（原巨田基金）管理有限公司行业研究员；2006 年 12 月至今，历任融通基金管理有限公司研究员、基金经理助理。

注：任职日期和离任日期均根据基金管理人对外披露的任免日期填写；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	-8.07%
本基金	-11.04%

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

上半年 A 股市场整体呈现宽幅震荡格局，沪深 300 指数跌 2.69%。2010 年成长股单边上行，累积巨大超额收益，随着今年初资金成本的抬高，不同风格资产之间存在明显纠偏需要，在周期品盈利增速超预期刺激下，以金融、地产为代表的周期性蓝筹表现优异，在一季度获得正收益；二季度国内 CPI 逐月上升，通胀压力加大。为此，央行货币政策持续紧缩，实体经济流动性偏紧，除个别供给端受限行业保持较高景气之外，大部分行业景气相比一季度呈显著下行态势。由于二季度 GDP 环比同比都呈下降态势，出于对整体宏观经济的担忧，A 股市场在 4 月中旬冲高之后，沪深 300 指数至季末出现了深达-15%左右的调整。整个二季度，A 股市场表现最好的板块为供求格局良好的水泥、煤炭、小金属等子行业，而中游行业和新兴产业由于成本端上升或估值高企出现了大幅调整。

新蓝筹基金在上半年整体采取了积极防御的策略。基于宏观紧缩和经济转型的环境判断，在控制整体仓位的同时，结构上年初降配了一批高估值的中小市值股票，但消费和新兴产业比重仍较高，因此受损。进入二季度本着长远眼光，仍然坚持以消费和新兴战略产业为基本配置，在优化组合传统品种的同时，增加了保险、工程机械、水泥、地产等行业的配置比例。总体策略是将组合向相对均衡方向布局，适当增强组合的进攻性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为-11.04%，同期业绩比较基准收益率为-1.54%。

正向贡献来自家电、建筑建材的配置，而医药生物、汽车、机械设备、信息服务等带来了负贡献。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年市场，我们认为整体投资环境好于上半年，流动性边际最紧以及大国博弈下的被动紧缩格局将发生适度转变。但在通胀压力没有明显消退之前，整体货币政策从紧的基调不会出现大的逆转。随着保障房、水利建设等财政项目的启动，同时，为缓解中小企业资金紧张的状况，货币政策可能会出现结构性放松。在此预判下，整体市场仍将呈宽幅振荡态势，向下能获得一定的估值支撑，向上受制于流动性以及由此导致的景气不确定。但总体市场比二季度能有所作为。

本基金投资策略：自上而下看好财政端受益资产，如水泥、工程机械等；同时放眼年底，我们认为基本面扎实的消费、新兴战略产业将会获得较好收益，通过自下而上发掘估值与成长性相匹配的"新蓝筹"优质中小盘成长型公司。本基金将在上述领域中选择有长期核心竞争力的公司进行重点配置，为持有人谋取持续稳健的投资回报。

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

本基金本报告期未进行利润分配，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

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 半年度财务报表（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：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2011年 6 月 30 日	上年度末 2010年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	1,119,371,255.29	1,215,353,415.67
结算备付金	9,922,964.48	26,832,432.47
存出保证金	4,334,890.37	4,054,560.64
交易性金融资产	11,277,049,273.90	13,423,033,010.64
其中：股票投资	8,792,327,273.90	10,350,928,010.64
基金投资	-	-
债券投资	2,484,722,000.00	3,072,105,000.00
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	-	79,786,873.81
应收利息	39,524,155.32	53,335,709.96
应收股利	-	-
应收申购款	289,156.78	1,316,400.73
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	12,450,491,696.14	14,803,712,403.92
负债和所有者权益	本期末 2011年 6 月 30 日	上年度末 2010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	44,234,099.92	48,986,049.66
应付赎回款	6,186,916.31	5,064,279.26
应付管理人报酬	14,966,736.58	19,143,875.34
应付托管费	2,494,456.08	3,190,645.88
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	6,383,793.50	12,281,570.09
应交税费	1,967,377.38	1,967,377.38
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,789,227.64	1,653,420.88
负债合计	78,022,607.41	92,287,218.49
所有者权益：		
实收基金	15,904,370,697.90	16,824,044,593.73
未分配利润	-3,531,901,609.17	-2,112,619,408.30
所有者权益合计	12,372,469,088.73	14,711,425,185.43
负债和所有者权益总计	12,450,491,696.14	14,803,712,403.92

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7779 元，基金份额总额 15,904,370,697.90 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：2011 年 1 月 1 日 至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
一、收入	-1,437,398,008.78	-2,635,426,098.76
1.利息收入	55,595,170.41	50,372,809.07
其中：存款利息收入	5,095,760.21	6,644,073.43
债券利息收入	46,229,988.83	43,728,735.64
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	4,269,421.37	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益	-95,681,940.26	266,621,301.74
其中：股票投资收益	-123,613,139.50	226,919,686.57
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-13,203,280.00	-693,085.00
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	41,134,479.24	40,394,700.17
3.公允价值变动收益	-1,398,952,505.15	-2,953,779,134.67
4.汇兑收益	-	-
5.其他收入	1,641,266.22	1,358,925.10
减：二、费用	139,397,144.03	170,875,211.80
1.管理人报酬	99,288,798.39	113,858,532.42
2.托管费	16,548,133.08	18,976,422.04
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	23,274,873.54	37,760,246.65
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	285,339.02	280,010.69
三、利润总额	-1,576,795,152.81	-2,806,301,310.56
减：所得税费用	-	-
四、净利润	-1,576,795,152.81	-2,806,301,310.56

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：2011 年 1 月 1 日 至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 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）	16,824,044,593.73	-2,112,619,408.30	14,711,425,185.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,576,795,152.81	-1,576,795,152.81
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-919,673,895.83	157,512,951.94	-762,160,943.89
其中：1.基金申购款	69,974,755.42	-13,006,575.49	56,968,179.93
2.基金赎回款	-989,648,651.25	170,519,527.43	-819,129,123.82
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）	15,904,370,697.90	-3,531,901,609.17	12,372,469,088.73
项目	上年度可比期间 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）	18,929,585,073.11	-2,168,030,652.62	16,761,554,420.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,806,301,310.56	-2,806,301,310.56
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-644,312,150.29	102,622,045.86	-541,690,104.43
其中：1.基金申购款	123,310,709.01	-21,565,984.10	101,744,724.91
2.基金赎回款	-767,622,859.30	124,188,029.96	-643,434,829.34
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）	18,285,272,922.82	-4,871,709,917.32	13,413,563,005.50

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

奚星华	奚星华	刘美丽
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

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、基金代销机构

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。

6.4.4 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

6.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 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	631,118,728.08	4.12%	-	-

6.4.4.1.2 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。

6.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 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	536,451.14	4.20%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 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	-	-	-	-

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。

6.4.4.2 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 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	99,288,798.39	113,858,532.42
其中：支付销售机构的客户维护费	21,319,272.35	24,406,381.00

注：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。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

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。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	16,548,133.08	18,976,422.04

注：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。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

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。

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

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日					
	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	-	-	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日					
	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	279,278,480.00	-	-	-	-	-

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基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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，基金管理人的主要股东及其控制的机构未持有本基金份额。

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 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 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	1,119,371,255.29	4,996,371.51	1,730,833,110.03	6,515,328.09

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

本基金无其他关联交易事项的说明。

6.4.5 期末（2011 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

金额单位：人民币元

6.4.5.1.1 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（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600166	福田汽车	2010年 9 月 16 日	2011年 9 月 14 日	非公开发行	18.06	8.68	10,000,000	90,300,000.00	86,800,000.00	-
601566	九牧王	2011年 5 月 23 日	2011年 8 月 30 日	新股	22.00	21.61	668,523	14,707,506.00	14,446,782.03	-

注：(1)本基金于 2010 年 9 月 16 日认购福田汽车非公开发行股票，认购数量 5,000,000 股；2011 年 5 月 16 日，福田汽车实施每 10 股送 10 股的利润分配方案，上表中的数量为送股实施后的总股数；

(2)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。

6.4.5.2 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
600315	上海家化	2010年 12 月 6 日	重大事项停牌	36.88	-	-	19,500.00	319,549.39	719,160.00	-

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

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。

6.4.5.3.2 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。

§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	8,792,327,273.90	70.62
	其中：股票	8,792,327,273.90	70.62
2	固定收益投资	2,484,722,000.00	19.96
	其中：债券	2,484,722,000.00	19.96
	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	1,129,294,219.77	9.07
6	其他各项资产	44,148,202.47	0.35
7	合计	12,450,491,696.14	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	12,210,000.00	0.10
B	采掘业	16,595,000.00	0.13
C	制造业	6,711,854,410.41	54.25
C0	食品、饮料	1,036,452,168.27	8.38
C1	纺织、服装、皮毛	200,759,642.59	1.62
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	303,221,823.70	2.45
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	487,645,562.21	3.94
C7	机械、设备、仪表	2,838,531,285.02	22.94
C8	医药、生物制品	1,845,243,928.62	14.91
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	78,442,412.19	0.63
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	267,736,325.60	2.16
H	批发和零售贸易	163,968,000.00	1.33
I	金融、保险业	698,192,344.82	5.64
J	房地产业	477,696,246.96	3.86
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	365,632,533.92	2.96
	合计	8,792,327,273.90	71.06

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	600166	福田汽车	98,034,512	850,939,564.16	6.88
2	600887	伊利股份	50,034,125	833,068,181.25	6.73
3	601318	中国平安	10,468,209	505,300,448.43	4.08
4	000538	云南白药	8,567,830	489,051,736.40	3.95
5	002007	华兰生物	13,496,216	458,061,571.04	3.70
6	000651	格力电器	18,471,229	434,073,881.50	3.51
7	002073	软控股份	19,927,626	410,509,095.60	3.32
8	600267	海正药业	10,400,000	388,336,000.00	3.14
9	600585	海螺水泥	11,899,600	330,332,896.00	2.67
10	600993	马应龙	15,636,842	297,412,734.84	2.40

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 名的股票投资明细

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	601318	中国平安	761,333,272.65	5.18
2	600585	海螺水泥	371,603,459.33	2.53
3	600016	民生银行	291,739,639.39	1.98
4	600031	三一重工	272,620,771.25	1.85
5	600015	华夏银行	258,085,065.27	1.75
6	002073	软控股份	233,655,064.84	1.59
7	600458	时代新材	213,929,067.31	1.45
8	601766	中国南车	193,593,852.83	1.32
9	600835	上海机电	186,409,491.45	1.27
10	000002	万 科 A	182,627,703.16	1.24
11	600309	烟台万华	173,729,501.56	1.18
12	000783	长江证券	173,515,120.00	1.18
13	000009	中国宝安	144,649,576.54	0.98
14	600141	兴发集团	141,780,780.89	0.96
15	600887	伊利股份	140,488,763.36	0.95
16	601818	光大银行	140,285,126.78	0.95
17	600256	广汇股份	138,217,056.87	0.94
18	600048	保利地产	136,428,908.71	0.93
19	000550	江铃汽车	133,642,944.71	0.91
20	000024	招商地产	129,418,133.37	0.88

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 名的股票投资明细

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	002069	獐 子 岛	334,526,642.75	2.27
2	002007	华兰生物	325,256,581.63	2.21
3	600585	海螺水泥	319,474,437.99	2.17
4	000009	中国宝安	318,115,805.10	2.16
5	601318	中国平安	305,192,806.09	2.07
6	600016	民生银行	288,442,443.17	1.96
7	000423	东阿阿胶	281,721,171.82	1.91
8	600570	恒生电子	245,566,548.18	1.67
9	000538	云南白药	241,020,590.32	1.64
10	600015	华夏银行	227,523,381.15	1.55
11	000926	福星股份	211,682,407.12	1.44
12	601766	中国南车	184,185,797.06	1.25
13	600309	烟台万华	168,642,680.61	1.15
14	600499	科达机电	150,781,057.54	1.02
15	600141	兴发集团	144,154,952.59	0.98
16	600079	人福医药	141,626,508.42	0.96
17	600694	大商股份	139,928,776.61	0.95
18	600256	广汇股份	137,079,515.11	0.93
19	601818	光大银行	127,928,536.44	0.87
20	600298	安琪酵母	121,488,348.01	0.83

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	7,645,446,848.26
卖出股票收入（成交）总额	7,670,354,680.35

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	82,400,000.00	0.67
2	央行票据	447,020,000.00	3.61
3	金融债券	1,955,302,000.00	15.80
	其中：政策性金融债	1,955,302,000.00	15.80
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	2,484,722,000.00	20.08

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	080413	08农发 13	4,000,000	400,000,000.00	3.23
2	080222	08国开 22	3,600,000	357,552,000.00	2.89
3	010215	01国开 15	3,500,000	350,140,000.00	2.83
4	110222	11国开 22	2,500,000	249,100,000.00	2.01
5	080414	08农发 14	2,000,000	200,300,000.00	1.62

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	4,334,890.37
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	39,524,155.32
5	应收申购款	289,156.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,148,202.47

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 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600166	福田汽车	86,800,000.00	0.70	非公开发行

§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
782,509	20,324.84	63,752,617.77	0.40%	15,840,618,080.13	99.60%

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	1,127,689.92	0.0071%

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2002 年 9 月 13 日）基金份额总额	2,218,864,742.31
本报告期期初基金份额总额	16,824,044,593.73
本报告期基金总申购份额	69,974,755.42
减：本报告期基金总赎回份额	989,648,651.25
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	15,904,370,697.90

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内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)自 2011 年 3 月 24 日起，张敏先生不再担任本基金的基金经理，刘模林先生、汪忠远先生继续担任本基金的基金经理，共同管理本基金。

具体内容请参阅 2011 年 3 月 26 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》上刊登的相关公告。

(2)经公司董事会审议并经中国证监会核准，奚星华先生担任公司总经理职务，颜锡廉先生（Allen Yan）担任公司副总经理职务，涂卫东先生担任公司督察长职务。经公司董事会审议并报中国证监会备案，吴冶平先生辞去公司督察长职务。

具体内容请参阅 2011 年 3 月 26 日在《证券时报》上刊登的相关公告。

(3)自 2011 年 4 月 6 日起，刘模林先生不再担任本基金的基金经理，增聘吴巍先生担任本基金的基金经理，与汪忠远先生共同管理本基金。

具体内容请参阅 2011 年 4 月 6 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》上刊登的相关公告。

10.2.2 本报告期基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

(1)本基金托管人 2011 年 1 月 31 日发布任免通知，解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。

(2)本基金托管人 2011 年 2 月 9 日发布公告，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理（主持工作），其任职资格已经中国证监会审核批准证监许可[2011]115 号）。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。

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改变。

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，仍为安永华明会计师事务所。

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

本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
中信建投	1	2,633,397,353.96	17.21%	2,139,651.21	16.74%	-
广发证券	1	1,915,557,305.67	12.52%	1,628,224.28	12.74%	-
华创证券	1	1,790,963,354.72	11.71%	1,522,313.43	11.91%	-
平安证券	2	1,220,786,328.80	7.98%	1,003,240.16	7.85%	-
长江证券	1	1,016,184,502.50	6.64%	825,657.17	6.46%	-
中银国际	1	781,701,455.16	5.11%	664,443.78	5.20%	-
瑞银证券	1	747,181,920.09	4.88%	635,104.75	4.97%	-
高华证券	1	728,233,730.27	4.76%	619,000.19	4.84%	-
兴业证券	1	726,320,770.84	4.75%	617,366.22	4.83%	-
新时代证券	1	631,118,728.08	4.12%	536,451.14	4.20%	-
东方证券	1	591,588,055.52	3.87%	502,853.95	3.93%	-
财达证券	1	529,932,791.55	3.46%	450,441.49	3.52%	-
华泰联合证券	1	491,665,063.27	3.21%	399,479.46	3.13%	-
中金公司	1	461,045,557.86	3.01%	374,601.44	2.93%	-
世纪证券	1	454,606,606.28	2.97%	386,413.59	3.02%	-
中信证券	1	177,281,310.31	1.16%	144,041.83	1.13%	-
安信证券	2	134,284,270.20	0.88%	109,106.66	0.85%	-
国信证券	1	112,008,950.32	0.73%	91,007.89	0.71%	-
国泰君安	1	84,596,423.91	0.55%	71,906.64	0.56%	-
申银万国	1	71,745,831.30	0.47%	60,984.06	0.48%	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金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标准包括以下六个方面：

(1)资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；

(2)财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

(3)经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；

(4)内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(5)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

(6)研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

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、交易单元变更情况

本报告期内，新增招商证券、恒泰证券交易单元各一个。

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
二〇一一年八月二十五日