融通通利系列证券投资基金更新招募说明书摘要

（2009年第2号）

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

重要提示

本系列基金包含三个子基金，分别是：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。

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金更新招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书摘要所载内容截止日为2009年9月30日，有关财务数据和净值表现截止日为2009年9月30日（财务数据未经审计）。

一、基金合同生效日

2003年9月30日

二、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：融通基金管理有限公司
注册地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层
办公地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层
设立日期：2001年5月22日
法定代表人：孟立坤
电话：（0755）26948041
联系人：李英华
注册资本：12500万元人民币

目前公司股东及出资比例为：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%。

（二）主要人员情况

1、董事会成员

董事长孟立坤先生，工学博士，现任新时代证券有限责任公司董事，历任河北证券有限责任公司北京营业部总经理、公司总裁助理（副总裁级）。

独立董事曹凤岐先生，教授，现任北京大学光华管理学院教授、北京大学金融与证券研究中心主任、国务院学位委员会学科评议组成员、中国金融学会常务理事、北京市金融学会副会长。历任北京大学经济系讲师；北京大学经济学院副教授、教授。

独立董事林义相先生，经济学博士，现任天相投资顾问有限公司董事长兼总经理。历任法国储蓄与信托银行股票投资分析师；中国证券监督管理委员会高级专家、研究信息部副主任、证券交易监控系统负责人；华夏证券有限公司副总裁，2001年至今，任职天相投资顾问有限公司董事长兼总经理。

独立董事强力先生，教授。现任西北政法学院教授、经济法系副主任、经济法学硕士研究生导师、金融证券法研究中心主任。

董事冯国安先生，工商管理硕士，现任日兴资产管理有限公司基金经理。历任花旗银行东京分行投资分析员；香港东方汇理资产管理公司基金经理；香港花旗银行私人银行部客户经理；2005年至今，任职日兴资产管理有限公司中国基金的投资与调研团队主管。

董事Allen Yan（颜锡廉）先生，工商管理硕士，现任日兴资产管理有限公司财务企划与分析部部长。历任美国富达投资公司财务分析员；日本富达投资公司财务经理；2006年至今，任职日兴资产管理有限公司财务企划与分析部部长。

董事马金声先生，高级经济师，现任新时代证券有限责任公司董事长。历任中国人民银行办公厅副主任、主任，金银管理司司长；中国农业发展银行副行长；国泰君安证券股份有限公司党委书记兼副董事长；华林证券有限责任公司党委书记。2006年至今，任新时代证券有限责任公司董事长。

董事吕秋梅女士，工商管理硕士，现任融通基金管理有限公司总经理。历任国信证券有限公司总裁助理；鹏华基金管理有限公司副总经理。2001年至今，历任融通基金管理有限公司常务副总经理、总经理。

董事吴冶平先生，经济学硕士，现任融通基金管理有限公司督察长。历任中国银行深圳国际信托咨询公司证券发行部项目经理；深圳市安信财务顾问有限公司上市策划部经理；华夏证券有限公司深圳分公司企业购并部经理；国信证券有限公司投资银行总部副总经理、公司研究部总经理；鹏华基金管理有限公司监事、研究部总监、基金经理助理。2001年至今，历任融通基金管理有限公司监察稽核部总监、督察长。

2、监事

监事程燕春先生，高级经济师，现任融通基金管理有限公司上海分公司总经理。历任中国建设银行南昌市分行城北支行行长；中国建设银行基金托管部市场处负责人。2001年至今，历任融通基金管理有限公司总经理助理、上海分公司总经理。

3、总经理及其他高级管理人员

总经理吕秋梅女士，同上。

副总经理刘模林先生，机械工程硕士。历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，现同时担任融通领先成长股票（LOF）基金基金经理和融通新蓝筹混合基金基金经理。

副总经理秦玮先生，工学硕士。历任中国工商银行深圳分行格兰信息咨询公司总经理助理、鹏华基金管理有限公司行政部总监；2002年至今，历任融通基金管理有限公司登记清算部总监、总经理助理。

督察长吴冶平先生，同上。

4、本系列基金基金经理

（1）融通债券基金

A、现任基金经理情况

乔羽夫先生，南开大学经济学硕士学位，5年证券从业经验。2000年9月至2001年10月，就职于深圳远永盛投资有限责任公司，从事证券交易工作；2004年9月至今，就职于融通基金管理有限公司，先后从事债券交易、债券研究以及债券投资等工作。现同时担任融通易支付货币基金经理。

在任职本基金基金经理前，乔羽夫先生未担任过基金经理。

B、历任基金经理情况

自2003年9月30日起至2004年7月20日，由徐荔蓉先生担任基金经理。
自2004年7月21日起至2008年3月30日，由陶武彬先生担任基金经理。
自2008年3月31日起至今，由乔羽夫先生担任基金经理。

（2）融通深证100指数基金

A、现任基金经理情况

郑毅先生，47岁，1988年毕业于南开大学经济研究所，研究生学历。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。

王建强先生，30岁，2001年毕业于西北大学，本科学历。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。

在任职本基金基金经理前，王建强先生未担任过基金经理。

B、历任基金经理情况

自2003年9月30日起至2009年5月14日，由张野先生担任基金经理。
自2009年5月15日起至今，由郑毅先生和王建强先生共同担任基金经理。

（3）融通蓝筹成长混合基金

A、现任基金经理情况

陈晓生先生，经济学硕士，14年证券从业经验。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、股票投资管理助理、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，现任公司总经理助理、融通动力先锋股票基金经理、融通内需驱动股票基金经理同时兼任日兴黄河基金融通模拟组合组合经理。

在任职本基金基金经理前，陈晓生先生担任融通动力先锋股票基金经理。

严菲女士，经济学硕士，6年证券从业经验。曾先后就职于日盛嘉富证券国际上海代表处、红塔证券从事证券研究工作。2006年7月加入融通基金管理有限公司任行业研究员。

在任职本基金基金经理前，严菲女士未担任过基金经理。

B、历任基金经理情况

自2003年9月30日起至2007年3月1日，由易万军先生担任基金经理。
自2007年3月2日起至今，由陈晓生先生及严菲女士共同担任基金经理。

5、上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金托管人

1、基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间：1984年1月1日
法定代表人：姜建清
注册资本：人民币334，018，850，026元
联系电话：（010）66105799

2、主要人员情况

截至2009年6月末，中国工商银行资产托管部共有员工117人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有硕士以上学位或高级职称。

3、基金托管业务经营情况

作为中国首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国工商银行始终坚持“诚实信用、勤勉尽责”的原则，严格履行着资产托管人的责任和义务，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的业务管理模式、健全的托管业务系统、强大的市场营销能力，为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务，取得了优异业绩。截至2009年6月，托管证券投资基金127只，其中封闭式8只，开放式119只。至今已形成包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社保基金、企业年金、产业基金、QFII资产、QDII资产等产品在内的托管业务体系。2009年初，中国工商银行先后被《环球金融》、《全球托管人》、《财资》和国内证券类年鉴《中国证券投资基金年鉴》及《证券时报》评选为2008年度“中国最佳托管银行”，自2004年以来，中国工商银行资产托管服务已经获得18项国内外大奖。

四、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构：

（1）融通基金管理有限公司深圳投资理财中心
办公地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层
邮政编码：518053
联系人：卢钟
电话：（0755）26948064
传真：（0755）26935005
客户服务中心电话：400-883-8088（免长途通话费用）、（0755）26948088

（2）融通基金管理有限公司北京分公司
办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座1241-1243单元
邮编：100140
联系人：宋雅萍
电话：（010）66190975
传真：（010）88091635

（3）融通基金管理有限公司上海分公司
办公地址：上海市浦东南路588号浦发大厦27层I、J单元
邮编：200120
联系人：林文兵
电话：（021）38424882
传真：（021）38424884

2、代销机构：

（1）中国工商银行股份有限公司
办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人：姜建清
电话：（010）66107900
传真：（010）66107914
联系人：田耕
公司网址：www.icbc.com.cn

（2）中国建设银行股份有限公司
办公地址：北京市西城区金融大街25号
法定代表人：郭树清
客户服务电话：95533
传真：（010）67598409
联系人：曲华蕊
公司网址：www.ccb.com

（3）交通银行股份有限公司
注册地址：上海市仙霞路18号
办公地址：上海市银城中路188号
法定代表人：胡怀邦
电话：（021）58781234
传真：（021）58408842
联系人：王玮
客户服务电话：95559
公司网址：www.bankcomm.com

（4）招商银行股份有限公司
注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人：秦晓
电话：（0755）83195834
传真：（0755）83195049
联系人：朱虹 刘薇
客服电话：95555
公司网址：www.cmbchina.com

（5）中信银行股份有限公司
注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人：孔丹
电话：（010）65557062
传真：（010）65550827
客户服务电话：95558
公司网址：http://bank.ecitic.com

（6）深圳发展银行股份有限公司
注册地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人：法兰克纽曼（Frank N.Newman）
电话：（0755）82088888转8811
传真：（0755）82080714
联系人：周勤
客户服务电话：95501
公司网址：www.sdb.com.cn

（7）中国光大银行股份有限公司（仅代销前端）
注册地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
法定代表人：唐双宁
电话：（010）68098778
传真：（010）68560661
联系人：李伟
客户服务电话：95595
公司网址：www.cebbank.com

（8）中国民生银行股份有限公司
办公地址：北京市东城区正义路甲4号
法定代表人：经叔平
客户服务电话：95568
电话：（010）58560666转8988
传真：（010）58560794
联系人：吴杰
公司网址：www.cmbc.com.cn

（9）北京银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街17号北京银行大厦
法定代表人：阎冰竹
代销联系人：李娟
电话：（010）66226044
传真：（010）66223314
客服热线：96169、96269、（021）53599688
公司网址：www.bankofbeijing.com.cn

（10）华夏银行股份有限公司（仅代销前端）
注册地址：北京市东城区建国门内大街22号
法定代表人：翟鸿祥
联系人：陈宇
电话：（010）85238423
客服热线：95577
网址：www.hxb.com.cn

（11）上海银行股份有限公司（仅代销融通深证100指数基金）
注册地址：上海市浦东新区银城中路168号
办公地址：上海市浦东新区银城中路168号
法定代表人：陈辛
开放式基金咨询电话：962888
开放式基金业务传真：（021）68476111
联系人：张萍
联系电话：（021）68475888
客服热线：962888
网址：www.bankofshanghai.com

（12）深圳平安银行股份有限公司
注册地址：深南中路1099号平安银行大厦
法定代表人：孙建一
注册资本：550200万元
联系人：霍兆龙
电话：（0755）25859591
传真：（0755）25879453
客服热线：40066-99999
网址：www.pingan.com

（13）国泰君安证券股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区商城路618号
办公地址：上海市延平路135号
法定代表人：祝幼一
电话：（021）62580818
传真：（021）62583439
联系人：芮敏祺
客服热线：400-8888-666
网址：www.gtja.com

（14）中信建投证券有限责任公司
注册地址：北京市北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：张佑君
电话：（010）65186758
传真：（010）65182261
联系人：权唐
客户服务电话：400-8888-108
网址：www.csc108.com

（15）国信证券股份有限公司
办公地址：深圳市红岭中路1012号国信证券大厦16-26层
法定代表人：何如
电话：（0755）82130833转2181
传真：（0755）82133302
联系人：林建闽
客服热线：800-8108-868
网址：www.guosen.com.cn

（16）招商证券股份有限公司
办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦38-45层
法定代表人：宫少林
电话：（0755）82943511
联系人：黄健
客服热线：95565、400-8888-111
网址：www.newone.com.cn

（17）广发证券股份有限公司
注册地址：广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室
办公地址：广州市天河北路大都会广场36、37、41和42楼
法定代表人：王志伟
电话：（020）87555888
传真：（020）87557985
联系人：肖中梅
网址：www.gf.com.cn

（18）中信证券股份有限公司
注册地址：深圳市湖贝路1030号海龙王大厦
办公地址：北京朝阳区新源南路6号京城大厦
法定代表人：王东明
电话：（010）84864818转63266
传真：（010）84865560
联系人：陈忠
客服热线：（010）84868330
网址：www.cs.ecitic.com

（19）中国银河证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座2-6层
法定代表人：胡长生
电话：（010）66568587
传真：（010）66568536
联系人：郭京华
客服热线：400-8888-888
网址：www.chinastock.com.cn

（20）海通证券股份有限公司
注册地址：上海淮海中路98号
办公地址：上海淮海中路98号
法定代表人：王开国
电话：（021）53594566转6507
传真：（021）53858549
联系人：金芸
客服热线：400-8888-001
网址：www.htsec.com

（21）华泰联合证券有限责任公司
办公地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层
法定代表人：马昭明
电话：（0755）82492000
传真：（0755）82492962
联系人：盛宗凌
客服热线：400-8888-555、（0755）25125666
网址：www.lhzq.com

（22）申银万国证券股份有限公司
注册地址：上海市常熟路171号
法定代表人：丁国荣
电话：（021）54033888
联系人：黄维琳
客服热线：（021）962505
网址：www.sw2000.com.cn

（23）兴业证券股份有限公司
注册地址：福建省福州市湖东路99号标力大厦
办公地址：上海市陆家嘴东路166号中保大厦
法定代表人：兰荣
电话：（021）68419974
联系人：杨盛芳
客服热线：（021）68419962
网址：www.xyzq.com.cn

（24）长江证券股份有限公司
注册地址：湖北省武汉市江汉区新华路特8号长江证券大厦
法定代表人：胡运钊
电话：（021）63219781
传真：（021）51062920
联系人：李良
客服热线：400-8888-999、（027）85808318
网址：www.95579.com

（25）安信证券有限责任公司
办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼
法定代表人：牛冠兴
电话：（0755）82825551
客服热线：（020）96210、（0755）82825555
网址：www.axzq.com.cn

（26）中信金通证券有限责任公司
注册地址：浙江省杭州市中河南路11号万凯商务庭院楼A座
法定代表人：刘军
联系人：何燕华
电话：（0571）85783752
传真：（0571）85783748
客服热线：96598
网址：www.bigsun.com.cn

（27）万联证券有限责任公司
注册地址：广州市中山二路18号电信广场36-37层
法定代表人：李舫金
电话：（020）87694550
传真：（020）87691530
联系人：熊辉
网址：www.wlzq.com.cn

（28）民生证券有限责任公司
总部地址：北京市西城区复兴门内大街158号远洋大厦13层
法人代表：岳献春
电话：（010）85252564
联系人：崔颖
客服热线：400-6198-888
网址：www.mszq.com

（29）国元证券有限责任公司
注册地址：合肥市寿春路179号
法定代表人：凤良志
联系人：程维
客服热线：95578
网址：www.gyzq.com.cn

（30）渤海证券有限责任公司
注册地址：天津市经济技术开发区第一大街29号
办公地址：天津市河西区宾水道3号
法定代表人：张志军
电话：（022）28451883
传真：（022）28451616
联系人：徐焕强
客服热线：（022）28455588
网址：www.ewww.com.cn

（31）山西证券有限责任公司
注册地址：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心
法定代表人：侯巍
电话：（0351）8686766、8686708
联系人：邹连星 刘文康
客户服务电话：（0351）8686868
网址：www.i618.com.cn

（32）中信万通证券有限责任公司
注册地址：青岛市东海路28号
法定代表人：史洁民
电话：（0532）5023457
联系人：丁韶燕
客服热线：96577
网址：www.zxwt.com.cn

（33）东吴证券有限责任公司
注册地址：江苏省苏州市十梓街298号
法定代表人：吴永敏
电话：（0512）65581136
传真：（0512）65588021
联系人：方晓丹
客服热线：（0512）65588066
网址：www.dwzq.com.cn

（34）东方证券股份有限公司
注册地址：上海市浦东大道720号20楼
法定代表人：王益民
电话：（021）50367888
联系人：盛云
客服热线：95503
网址：www.dfzq.com.cn

（35）方正证券有限责任公司
注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法定代表人：雷杰
联系人：刑铁英
电话：（0571）87782047
传真：（0571）87782011
客服热线：95571
网址：www.foundersc.com

（36）长城证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人：黄耀华
电话：（0755）83516094
传真：（0755）83516199
联系人：高峰
客服热线：400-6666-888、（0755）82288968
网址：www.cc168.com.cn

（37）光大证券股份有限公司
注册地址：上海市静安区新闸路1508号3楼
法定代表人：王明权
联系人：刘晨
电话：（021）22169081
传真：（021）22169134
客服热线：400-8888-788、10108998
网址：www.ebscn.com

（38）东北证券股份有限公司
注册地址：长春市人民大街1138号
办公地址：长春市自由大路1138号
法定代表人：李树
电话：（0431）5096710
传真：（0431）5680032
联系人：高新宇
开放式基金咨询电话：（0431）96688转0；（0431）5096733
公司网址：www.nesc.cn

（39）新时代证券有限责任公司
注册地址：北京市西城区月坛大厦15层
法定代表人：马金声
联系人：戴荻
电话：（010）68084591
传真：（010）68084986
客服热线：400-6989-898
公司网址：www.xsdzq.cn

（40）国联证券有限责任公司
注册地址：无锡市县前东街8号
法定代表人：范炎
电话：（0510）2831662
联系人：袁丽萍
客服热线：400-888-5288、（0510）82588168
网址：www.glsc.com.cn

（41）平安证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区八卦三路平安大厦3楼
法定代表人：陈敬达
电话：（0755）82440136、82450826
联系人：余江
客服热线：400-8866-338，（0755）82422251
网址：www.pa18.com

（42）华安证券有限责任公司
注册地址：安徽省合肥市长江中路357号
法定代表人：李工
电话：（0551）5161671
联系人：唐泳
网址：www.huaans.com.cn

（43）国都证券有限责任公司
注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人：王少华
电话：（010）64482828转390
传真：（010）64482090
客服热线：4008488118
网址：www.guodu.com

（44）恒泰证券有限责任公司
联系地址：呼和浩特市新城区东风路111号
法定代表人：刘汝军
业务联系人：魏华
联系电话：（0471）4961259
传真：（0471）4961259
网址：www.cnht.com.cn

（45）国盛证券有限责任公司
注册地址：江西省南昌市永叔路15号（330003）
办公地址：江西省南昌市永叔路15号信达大厦10-13楼
法定代表人：管荣升
联系：（0791）6289771
传真：（0791）6289395
联系人：万齐志
网址：www.gsstock.com

（46）宏源证券股份有限公司
注册地址：新疆乌鲁木齐市建设路2号
法定代表人：汤世生
电话：（010）62267799转6416
传真：（010）62294470
联系人：张智红
客户服务热线：（010）622767799转6789
公司网址：www.ehongyuan.com.cn

（47）第一创业证券有限责任公司
办公地址：深圳市笋岗路中民时代广场B座25楼
法定代表人：刘学民
电话：（0755）25832493
传真：（0755）25831718
客服热线：（0755）25832583
网址：www.firstcapital.com.cn

（48）金元证券股份有限公司
注册地址：海口市南宝路36号证券大厦4楼
办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心17层
法定代表人：陆涛
电话：（0755）83025022
传真：（0755）83025625
联系人：张萍
客服热线：4008-888-228
网址：www.jyzq.com.cn

（49）西部证券股份有限公司
注册地址：西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层
法定代表人：刘建武
电话：（029）87406172
传真：（029）87406387
联系人：黄晓军
客户服务电话：（029）87419999
公司网址：www.westsecu.com.cn

（50）信泰证券有限责任公司
注册地址：南京市长江路88号
法定代表人：钱凯法
电话：（025）84784765
传真：（025）84784830
联系人：舒萌菲
公司网址：www.thope.com

（51）华龙证券有限责任公司
联系地址：甘肃省兰州市静宁路138号
法定代表人：李晓安
业务联系人：王宝国
联系电话：（0931）4890068
传真：（0931）4890515
网址：www.hlzqgs.com

（52）天相投资顾问有限公司
办公地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层
法定代表人：林义相
电话：010-66045577
联系人：林爽

（53）华泰证券股份有限公司
住所：江苏省南京市中山东路90号
办公地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
电话：（025）84457777转882、721
传真：（025）84579879
联系人：袁红彬

（54）上海证券有限责任公司
办公地址：上海市银城中路168号
法定代表人：陈辛
电话：021-68475888
联系人：张萍

（二）注册登记人

名称：融通基金管理有限公司
注册地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层
办公地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层
邮政编码：518053
法定代表人：孟立坤
电话：（0755）26948075
传真：（0755）26935011
联系人：杜嘉
客服热线：400-883-8088，（0755）26948088
网址：www.rtfund.com

（三）律师事务所和经办律师

名称：康达律师事务所
注册地址：北京市朝阳区建国门外大街19号国际大厦703室
办公地址：北京市朝阳区建国门外大街19号国际大厦703室
法定代表人：傅洋
联系人：娄爱东 王琪
经办律师：李赫 肖钢
电话：（010）85262828
传真：（010）85262826

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室
办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼（邮编：200021）
法人代表：杨绍信
电话：（021）23238888
传真：（021）23238800
联系人：陈兆欣
经办注册会计师：薛竞、单峰

五、基金的名称

融通通利系列证券投资基金

六、基金的类型

契约型开放式

七、基金的投资目标

（一）融通债券基金

在强调本金安全的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。

（二）融通深证100指数基金

融通深证100指数基金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。

如果深证100指数被停止发布、或由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为目标指数的情形下，或者证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，基金管理人可以相应变更基金的投资目标、投资范围和投资策略。

（三）融通蓝筹成长混合基金

融通蓝筹成长混合基金主要投资于具有较高内在投资价值的优质蓝筹公司和具有很强的核心竞争优势、业绩能够持续增长或具有增长潜力的成长型公司。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，追求资产的长期增值。

八、基金的投资方向

（一）融通债券基金

主要投资于低信用风险和中低流动性风险的债券组合，而利率风险则根据组合优化的需要分布在高中低等不同的风险等级上。

（二）融通深证100指数基金

主要投资于深证100指数成份股和债券。

（三）融通蓝筹成长混合基金

融通蓝筹成长混合基金的投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。融通蓝筹成长混合基金严格限定将相当比例的基金资产投资于符合蓝筹成长投资标准的投资对象；同时将根据市场状况调整投资组合，把握投资机会，实现组合的进一步优化。

九、基金的投资策略

A、融通债券基金

（一）投资策略

本基金以组合优化为基本策略，利用收益曲线模型和债券品种定价模型，在获取较好的稳定收益的基础上，捕捉市场出现的中短期投资机会。根据投资决策的过程，具体如下：

1、总体资产配置自上而下

利率是债券市场的主导因素，本基金将在宏观研究的基础上对未来利率变化趋势进行预测，形成债券投资决策的最根本依据；利率期限结构对未来利率的变动具有重要参考和预测功能，本系列基金将基于实时的期限结构变化，给出利率变动预警信号。总体资产配置中将根据宏观经济和期限结构的有关研究成果，设定债券组合的久期，控制整体的利率风险。此外，结合市场特征，充分考虑流动性风险、信用风险等其他风险指标，对银行间国债市场、银行间金融债市场、交易所国债市场和交易所企业债市场给予不同的久期进行资产分配。

本基金将保留适量的现金以应付赎回或开展逆回购，以便获得较高的收益。

2、类属配置组合优化

在总体资产配置之下，对类属配置采取给定久期的凸度优化、收益率优化、交易量优化等多种优化组合策略，最终优化的比例是一个多目标规划的结果。

债券市场存在无效之处，本基金将结合收益曲线模型和收益率优化模型把握市场出现的短暂机会，提高组合的投资收益。

3、单个品种合理定价

本基金力求通过绝对和相对定价模型对市场上所有债券品种进行合理的定价，基于对每个品种的绝对和相对定价，进行债券品种的投资价值分析。

4、风险控制之下追求收益最大

目前我国债券投资的风险主要来自于利率风险，本基金将通过组合的久期管理来控制债券组合的利率风险，然后通过凸度优化和收益率优化等追求收益的最大化。

可转债的投资风险主要来源于股价的波动，在投资可转债的总体比例上，本基金将根据VaR风险控制模型进行调控。在可转债品种的选择上，本基金将主要通过股票定价模型和行业研究员对股票的评级等综合判断其股票投资价值，力争实现较高的收益。

（二）投资决策

1、决策依据

（1）国家有关法律、法规和基金合同的规定；
（2）国家宏观经济环境及其对债券市场的影响；
（3）国家货币政策、财政政策以及证券市场政策；
（4）发债公司财务状况、行业处境、经济和市场需求状况及其当前市场价格；
（5）货币市场、资本市场资金供求状况及未来走势。

2、决策程序

（1）确定投资策略

基金经理在宏观、债券以及金融工程研究员提供的研究报告和模型的基础上完成最终的投资策略报告，并上报投资决策委员会审批。投资决策委员会修改批准后，交由风险控制委员会备案监督，并由基金经理进行具体实施。

（2）进行资产配置

基金经理将根据上述研究报告和投资策略报告，对基金资产在每个市场进行合理的配置，为每个债券组合设计合理的久期，并根据基金投资风格对每个市场组合进行不同的风险设置。

（3）建立投资组合

运用组合优化模型构建初始比例，然后根据市场的变动情况及时对组合进行调整。但是调整的幅度不得超越整体的投资策略和资产配置策略。

（4）组合监控与调整

组合监控与调整的理由主要来自于两个方面，一是可能出现市场失效，例如出现了极具吸引力的短线买入或者卖出机会；二是风险控制的需要，由专门的风险管理小组对持仓和交易进行监控，基金经理或者风险管理小组发现组合局部或者整体风险超标时，基金经理应立即对组合进行调整。

（5）风险报告与业绩分析

风险管理小组定期对本基金进行风险分析和业绩评价，为未来的管理提供客观的依据。

（三）投资组合管理

本基金投资于国债、金融债和企业债（包括可转债），投资组合必须符合以下规定：

1、投资于债券的比例不低于本基金资产总值的80%，投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的20%；
2、本基金与由本基金管理人管理的其他基金合计持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%；
3、持有现金或到期日在一年之内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%；
4、遵守中国证监会规定的其他比例限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素使基金投资不符合上述1至2项规定的比例的，基金管理人应当在法规规定期限内进行调整。

（四）资产支持证券的投资策略、风险控制措施及投资比例

1、投资策略

基金管理人在确保与基金投资目标相一致的前提下，可本着谨慎和风险可控的原则，为取得与承担风险相称的收益，投资于资产支持证券。

（1）买入持有策略

基金可在与投资目标一致的前提下，买入并持有资产支持证券，以获取相应的利息收入。

（2）利率预期策略

根据对利率趋势、提前还款率等的预期，预测资产支持证券收益率的变化趋势，从而决定对资产支持证券的买入或卖出。

（3）信用利差策略

通过对资产支持证券的信用评估，分析预期违约率和违约损失率的变化趋势，评估其信用利差是否合理，并预测其变化趋势，通过其信用质量的改善和信用利差的缩小获利。

（4）相对价值策略

基金通过计算资产支持证券的名义利差、静态利差及期权调整利差等指标，将资产支持证券的收益风险特征与其他资产类别和债券的收益风险比较，确定其是否具有相对价值，从而决定对其整体或个券的买入和卖出。

2、风险控制措施

（1）通过严格的投资流程控制投资风险，基金经理及有关人员必须严格执行投资授权制度。

（2）在投资资产支持证券时，首先应由固定收益研究员提出资产支持证券产品的风险收益报告和投资建议，基金经理根据投委会决定的资产配置计划和相应的投资权限，参考固定收益研究员的资产支持证券的风险收益报告，充分评估资产支持证券的风险收益特征，确定具体投资方案，在严格控制风险的前提下，谨慎进行投资。

（3）基金交易部负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责，监控内容包括基金资产支持证券投资比例及交易对手风险控制等。

（4）固定收益小组对资产支持证券投资进行风险和绩效评估，密切跟踪影响基金所投资资产支持证券信用质量变化的各种因素，并在投资中进行相应操作，以规避信用风险的上升。

（5）固定收益小组负责不断完善资产支持证券定价模型，并评估模型风险。密切跟踪影响资产支持证券收益率变化的各种因素，并评估其对资产支持证券持有期收益的影响，并进行相应的投资操作。

（6）基金经理在投资决策时将评估资产支持证券的上市等流动性安排，并考虑其对基金资产流动性的影响，分散投资，确保所投资的资产支持证券具有适当的流动性。

（7）基金经理将密切关注影响债务人提前偿还的各种因素，并评估其对资产支持证券投资价值的影响，并进行相应的投资决策。

（8）不断完善内部控制制度及相应技术手段，使基金相关操作以谨慎安全的方式进行，确保基金及持有人利益得到保障。

（9）严格审查所投资资产支持证券的法律文件，确保各业务环节都有适当的法律保障。

3、本基金可投资资产支持证券。

（1）持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例不得超过该资产支持证券规模的10%。

（2）投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例不得超过基金资产净值的10%。

（3）与基金管理人管理的其它基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%。

（4）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的20%。

（5）因市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资资产支持证券不符合上述第（2）项和第（4）项规定的比例，基金管理人将在10交易日内调整完毕。

（6）投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级。本基金应投资于信用级别为BBB以上（含BBB）的资产支持债券。在持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出。

B、融通深证100指数基金

（一）投资策略

本基金以基金非债券资产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%，相对于深证100指数的日跟踪误差不超过0.5%。因基金规模或市场变化导致投资组合不能满足上述比例不在限制之内，但基金管理人应在合理期限内进行调整，以达到上述标准。

（二）投资决策

1、决策依据

（1）国家有关法律、法规和基金合同的有关规定；
（2）宏观经济形势及前景，经济政策趋向；
（3）本基金跟踪误差的控制管理；
（4）行业及上市公司基本面研究；
（5）提前或延后指数成份股的变更。根据指数编制规则，预测指数成份股可能发生的变动以及对股价的影响，提前或延后调整成份股。

2、决策程序

（1）研究策划部提供宏观分析、利率和通货膨胀分析、深证100指数成份股公司的研究报告；金融工程小组利用模型进行历史模拟和风险测算。在此基础上进行投资论证，做出投资建议提交给基金经理，并为投资决策委员会提供资产配置的决策依据。

（2）基金经理根据研究策划部提交的投资建议初步决定下一阶段的资产配置提案报投资决策委员会。

（3）投资决策委员会审定基金经理提交的资产配置提案，形成资产配置计划书。

（4）基金经理根据投资决策委员会的决策，制定相应的指数投资和债券投资组合方案并报投资决策委员会备案。对超出基金经理权限的单项投资决策须报投资决策委员会审议批准。

（5）基金经理根据投资组合方案制定具体的操作计划，并以投资指令的形式下达至基金交易部。

（6）基金交易部依据投资指令具体执行买卖操作，并将指令的执行情况反馈给基金经理。

（7）金融工程小组负责对基金组合的跟踪误差和风险进行评估，定期提交组合跟踪误差和风险监控报告。在跟踪误差超过一定范围时，通知基金经理和相关部门，及时进行投资组合的调整。

（8）投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施。监察稽核部对投资的决策和执行过程进行日常监督，投资组合方案执行完毕，基金经理负责向投资决策委员会提交总结报告。

（三）资产支持证券的投资策略、风险控制措施及投资比例

同融通债券基金。

（四）投资组合管理

本基金主要投资于股票、国债等。投资组合必须符合以下规定：

1、投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的80%；
2、持有一家上市公司的股票，不得超过本基金资产净值的10%；
3、本基金与由本基金管理人管理的其他基金合计持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%；
4、现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%；
5、遵守中国证监会规定的其他比例限制；

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素使基金投资不符合上述1至3项规定的比例的，基金管理人应当在法规规定期限内进行调整。

C、融通蓝筹成长混合基金

（一）投资策略

1、资产配置

贯彻自上而下的投资策略，结合宏观经济状况、资本市场的运行周期确定风险收益互补的股票资产和债券资产的投资比例。

2、行业资产配置

在蓝筹成长型投资理念的指导下，通过对宏观经济、行业经济的把握以及对行业运行周期的认识，确定股票资产在不同行业的投资比例。

3、债券选择

分析利率走势和发行人的基本素质，综合考虑利率变动对不同债券品种的影响、各品种的收益率水平、期限结构、信用风险大小、市场流动性因素；另一方面考虑宏观经济数据，包括通货膨胀率、商品价格和GDP增长等因素。

4、股票选择

本基金为蓝筹成长型基金。其股票投资主要包括两部分：一部分为蓝筹股投资，另一部分为成长型投资。对蓝筹上市公司或成长型上市公司的投资均不得低于股票投资总额的30%。

本基金投资的蓝筹公司具有以下主要特点：

（1）行业地位突出，收益稳定，属于相对成熟、稳定的行业；
（2）业绩优异，盈利能力强，由于投资回报高而具备投资价值；
（3）股本较大，市值以及权重较大、市场地位突出；
（4）市场形象良好，这源自于稳定可观的公司收益及投资回报，良好的股价走势（慢牛特征、抗跌性较强）等等；

本基金投资的成长型上市公司具有以下主要特点：

（1）公司发展前景好，主营产品或服务的市场有充分的成长空间，销售增长率或收益增长率高；
（2）公司是中小型公司，有优于同行其他公司的某种竞争优势；
（3）公司具有高成长潜力，已建立并形成较好的发展基础；
（4）公司处于技术（方法）革新时期，有较强的管理层，具有较大发展空间。

5、权证投资

根据权证作为衍生品种本身的特性和作用，本基金在权证投资上主要运用以下投资策略：基于标的证券未来合理估值范围分析及权证定量分析基础上的头寸保护策略及跨式权证投资策略；基于权证杠杆比率及Delta对冲比率分析基础上的权证替换投资策略；基于Black-Scholes等权证合理定价分析方法基础上的权证与标的证券的套利投资策略。

（二）投资决策

1、决策依据

（1）国家宏观经济环境；
（2）国家有关法律、法规和基金合同的有关规定；
（3）货币政策、利率走势；
（4）地区及行业发展状况；
（5）上市公司研究；
（6）证券市场的走势。

2、决策程序

（1）研究策划部提供宏观分析、行业分析、企业分析及市场分析的研究报告，并在此基础上进行投资论证，作出投资建议提交给基金经理，并为投资决策委员会提供资产配置的决策依据。

（2）基金经理根据研究策划部提交的投资建议决定本基金下一阶段的仓位和资金分布，形成资产配置提案报投资决策委员会。

（3）投资决策委员会审定基金经理提交的资产配置提案，形成资产配置计划书。

（4）基金经理根据投资决策委员会的决策，制定相应的投资组合方案并报投资决策委员会备案。对超出基金经理权限的单项投资决策须报投资决策委员会审议批准。

（5）基金经理根据投资组合方案制定具体的操作计划，并以投资指令的形式下达至基金交易部。

（6）基金交易部依据投资指令具体执行买卖操作，并将指令的执行情况反馈给基金经理。

（7）投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施。监察稽核部对投资的决策和执行过程进行日常监督，投资组合方案执行完毕，基金经理负责向投资决策委员会提交总结报告。

（三）资产支持证券的投资策略、风险控制措施及投资比例

同融通债券基金。

（四）投资组合管理

本基金可投资于股票、国债、金融债、企业债（包括可转债）和权证。投资组合必须符合以下规定：

1、投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的80%，投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的20%；
2、持有一家上市公司的股票，不得超过本基金资产净值的10%；
3、本基金与由本基金管理人管理的其他基金合计持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%；
4、本基金持有的全部权证，其市值不超过基金资产净值的3%；本基金与由本基金管理人管理的的其他基金基金持有的同一权证不得超过该权证流通量的10%。
5、持有现金或到期日在一年之内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%；
6、遵守中国证监会规定的其他比例限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素使基金投资不符合上述1至4项及规定的比例的，基金管理人应当在法规规定期限内进行调整。

十、基金的业绩比较标准

（一）融通债券基金

全国银行间同业拆借中心编制的银行间债券综合指数。

（二）融通深证100指数基金

深证100指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。

（三）融通蓝筹成长混合基金

国泰君安指数×75%+银行间债券综合指数×25%。

十一、基金的风险收益特征

融通债券基金：属于相对低风险的基金品种。
融通深证100指数基金：风险和预期收益率接近市场平均水平。
融通蓝筹成长混合基金：力求获得超过市场平均水平的收益，承担相应的风险。

十二、基金的投资组合报告

本系列基金管理人的董事会及董事保证本投资组合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。

本系列基金托管人中国工商银行根据本系列基金合同规定，于2009年10月30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。本投资组合报告截止日为2009年9月30日。本部分中的“本报告期内”指自2009年7月1日至2009年9月30日期间。

（一）融通债券基金投资组合报告

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	0.00	0.00
	其中：股票	0.00	0.00
2	固定收益投资	465，584，994.70	87.13
	其中：债券	445，603，995.35	83.39
	资产支持证券	19，980，999.35	3.74
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	26，771，190.21	5.01
6	其他资产	42，014，380.35	7.86
7	合计	534，370，565.26	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金投资范围不包括股票投资。

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

本基金投资范围不包括股票投资。

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	36，099，000.00	7.05
2	央行票据	81，327，000.00	15.89
3	金融债券	118，665，000.00	23.18
	其中：政策性金融债	118，665，000.00	23.18
4	企业债券	171，519，902.00	33.51
5	企业短期融资券	0.00	0.00
6	可转债	37，993，093.35	7.42
7	其他	0.00	0.00
8	合计	445，603，995.35	87.05

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	0801047	08央行票据47	500，000	51，840，000.00	10.13
2	090402	09农发02	500，000	49，675，000.00	9.70
3	080223	08国开23	500，000	49，260，000.00	9.62
4	126002	06中化债	443，080	40，413，326.80	7.90
5	010112	21国债⑿	300，000	30，894，000.00	6.04

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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	119004	澜电03	200，000	19，980，999.35	3.90

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。

8、投资组合报告附注

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。

8.2 本基金投资范围限于固定收益类金融工具，不包括股票投资。

8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	250，000.00
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	0.00
4	应收利息	6，687，534.93
5	应收申购款	35，076，845.42
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	0.00
8	其他	0.00
9	合计	42，014，380.35

8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110003	新钢转债	20，457，421.20	4.00
2	125960	锡业转债	3，681，421.15	0.72

8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金投资范围限于固定收益类金融工具，不包括股票投资。

（二）融通深证100指数基金投资组合报告

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

2、报告期末按行业分类的股票投资组合 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

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。

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

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

3.2 积极投资部分

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

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、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

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。

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。

8、投资组合报告附注

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。

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。

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

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。

8.5 期末前五名股票中存在流通受限情况的说明

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。

（下转B22版）