中信现金优势货币市场基金 2006年第三季度报告

一、重要提示

中信现金优势货币市场基金管理人—中信基金管理有限责任公司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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2006年10月23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。

按照中国证监会《证券投资基金信息披露内容与格式准则第4号——季度报告的内容与格式》第五条“基金季度报告中的财务资料无须审计，但中国证监会或证券交易所另有规定的除外”的规定，本基金本季度报告的财务资料未经审计。

中信基金管理有限责任公司承诺以诚实信用、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。

本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。

二、基金产品概况

基金全称：中信现金优势货币市场证券投资基金

基金简称：中信现金优势货币市场基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2005年4月20日

报告期末基金份额总额：974,399,391.00份

投资目标：在保持安全性、高流动性的前提下获得高于投资基准的回报。

投资策略：结合货币市场利率的预测与现金需求安排，采取现金流管理策略进行货币市场工具投资，以便在保证基金财产的安全性和流动性的基础上，获得较高的收益。

业绩比较基准：本基金以中国人民银行公布的一年期定期存款的税后收益率作为业绩比较基准。

风险收益特征：基金投资于货币市场工具，属于低风险品种。

基金管理人：中信基金管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

三、主要财务指标和基金净值表现

(一)主要财务指标

1.基金本期净收益：6,559,501.68元

2.期末基金资产净值：974,399,391.00元

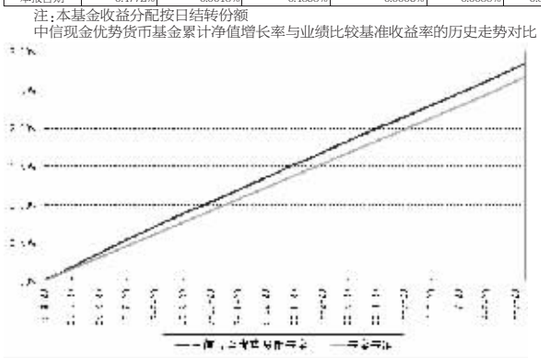
(二)基金净值表现

1.中信现金优势货币市场基金本报告期收益率与同期业绩比较基准收益率比较：

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
本报告期	0.4772%	0.0018%	0.4858%	0.0003%	-0.0086%	0.0015%

注：本基金收益分配按日结转份额

中信现金优势货币基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比



四、管理人报告

(一)基金经理小组成员介绍

王洪涛先生，经济学硕士。8年金融、证券从业经历，曾任平安证券债券部投资经理、平安保险投资管理中心投资组合经理助理、招商证券研发中心产品开发部经理及研发中心总经理助理、光大控股创业投资(深圳)有限公司资产管理部总经理。2003年加入中信基金管理有限责任公司，负责债券投资业务，任中信现金优势货币市场基金基金经理。

李广云先生，中央财经大学经济学学士，英国华威大学商学院理科硕士。曾在平安保险，招商证券工作，负责投资组合管理，量化研究业务，有6年金融从业经历。2003年加入中信基金管理公司投资部，进行债券投资及研究，任中信现金优势货币市场基金基金经理助理。

(二)基金运作合规性说明

基金管理人在本报告期内，严格遵守《基金法》、《货币市场基金管理暂行办法》及其他有关法律法规和基金合同的规定，克尽职守、勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在违法、违规行为及违反基金合同的行为。

(三) 报告期货币市场及基金投资运作回顾

1、货币市场回顾

二季度经济呈现过热的迹象，突出体现在固定资产投资、银行贷款、货币供应量等方面，国务院层面及各主管部门陆续出台相应的宏观调控措施进行调控，央行为了控制扩币供应量和银行贷款增长过快的状况，除了运用常规的公开市场操作加大回收流动性之外，还陆续运用了提升银行存款准备金率、实施差别银行存款准备金率、提升银行存贷款利率等法规和行政的手段。银监会亦出台控制银行贷款增长过快的指令性措施。发改委、建设部等行政部门也出台相应措施控制固定资产增长过快的局面。

经过密集的和综合的宏观调控，三季度宏观数据显示经济增长从高位平稳回落。固定资产投资增长由6月份的34.4%下降至8月份的21.5%，8月份的水平明显低于去年同期的28.5%。物价指数(CPI)在低位徘徊7、8、9月分别为1%、1.3%、1.5%。货币供应量和贷款在上半年高速增长的基础上，呈现明显回落，7、8、9月M2增速分别为18.4%、17.9%、16.8%。7、8、9月份的银行新增贷款为1718亿元、1875亿元、2201亿元，增幅出现明显回落。但三季度的外贸顺差在历史高位，9月份外贸顺差较8月份的188亿美元虽然有所回落，但仍高达153亿美元；前9月顺差累计已达1098亿美元，已超过去年全年总和(1021亿美元)。人民币在三季度也明显加快了升值的速度。

期初由于IPO时隔两年之后重新启动和中行等大盘股的发行，导致市场利率急速上升，出现年内的高点。随着宏观经济的平稳回落，宏观调控措施的缓和，以及央行公开市场操作更加成熟，银行间市场在二季度末体现的流动性紧张局面得到缓解，银行间债券市场情绪逐步乐观，买券日渐踊跃，充裕资金推动各期限债券收益率明显下降。1年期央票收益率从三季度初的2.90%左右回落至季度底2.78%。

图1：央票发行利率1年，6个月，3个月 (2006年1-9月)

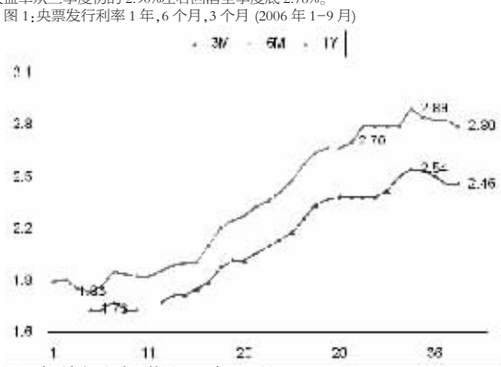


图2：央票发行量，净回笼量(2006年1-9月)

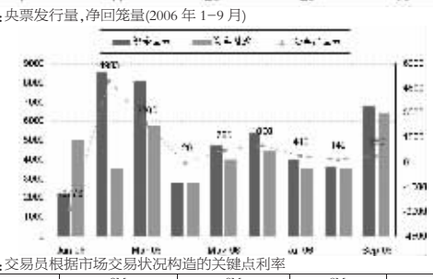


图3：交易员根据市场交易状况构造的关键点利率

	3M	6M	9M	1Y
6月23日	2.3	2.45	2.57	2.65
7月25日	2.6	2.7	2.8	2.87
8月18日	2.5	2.6	2.7	2.8
8月23日	2.5	2.7	2.8	2.89
9月22日	2.46	2.58	2.68	2.77

而短期融资券的发行仍保持快速增长的局面，一级市场发行收益率逐步攀升，而且由于福禧事件，不同信用级别的短期融资券的收益率差别逐步拉大，定价也更加合理，与同期央票的利差保持在20-200BP之间。

2、投资运作回顾

经历了利率大幅上升、流动性急剧紧张、以及基金规模的快速缩减的洗礼，货币基金的投资操作更加理性和成熟，综观三季度，货币基金的规模受股票市场的影响，持续的小幅回落，操作的方向主要是减持基金持仓品种，考虑到不同品种上的息差和流动性变化，也进行了持仓品种的调整，增加了央票和金融债券的持仓比例，降低了银行定期存款和短期融资券的持仓比例，在规模减少的同时，组合的流动性和静态收益不断提升。

五、投资组合报告

(一)报告期末基金资产组合

资产组合	金额(单位：人民币元)	占基金总资产比例(%)
债券投资	932,813,235.23	89.22
买入返售证券	0.00	0.00
其中：买断式回购的买入返售证券	0.00	0.00
银行存款和清算备付金合计	108,266,067.33	10.35
其他资产	4,478,807.82	0.43
合计	1,045,558,110.38	100.00

注：银行存款和清算备付金合计中包括定期存款100,000,000元。

(二)报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(单位：人民币元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	9,002,000,000.00	7.14
	其中：买断式回购融资	0.00	0.00
2	报告期末债券回购融资余额	70,000,000.00	7.18
	其中：买断式回购融资	0.00	0.00

(三)基金投资组合平均剩余期限

1、投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	124
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	162
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	48

2、期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	21.36	7.18
2	30天(含)—60天	5.12	0.00
3	60天(含)—90天	18.40	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	18.40	0.00
4	90天(含)—180天	28.51	0.00
5	180天(含)—397天(含)	33.45	0.00
合计		106.84	7.18

(四)报告期末债券投资组合

1、期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	成本(单位：人民币元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	0.00	0.00
2	金融债券	299,745,935.96	30.76
	其中：政策性金融债	299,745,935.96	30.76
3	央行票据	544,566,540.45	55.89
4	企业债券	88,500,758.82	9.08
5	其他	0.00	0.00
合计		932,813,235.23	95.73
剩余存续期超过397天的浮动利率债券		179,288,034.02	18.40

2、基金投资前十名债券明细

序号	债券名称	债券数量(张) 自有投资	买断式回购	成本(单位：人民币元)	占基金资产净值的比例(%)
1	06央行票据28	1500000		147,503,512.32	15.14
2	05央行票据99	1000000		99,879,538.57	10.25
3	05农发06	1000000		99,305,915.50	10.19
4	06央行票据04	1000000		99,059,166.68	10.17
5	06央行票据08	1000000		98,956,300.00	10.16
6	05国开07	800000		79,982,118.52	8.21
7	05国开02	700000		70,243,825.14	7.21
8	04国开21	500000		50,214,076.80	5.15
9	05央行票据108	500000		49,859,649.34	5.12
10	06央行票据18	500000		49,308,373.54	5.06

(五)“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	6
报告期内偏离度的最高值	0.3367%
报告期内偏离度的最低值	-0.1797%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1098%

(六)投资组合报告附注

1、本基金的计价方法

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率每日计提利息，并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在1.0000元。

2、本报告期内，本基金不存在持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过报告期末基金资产净值的20%的情况。

3、本报告期内需说明证券投资决策程序

(1)投资管理组织结构

基金管理人投资管理队伍强调结构化和专业化，实行投资管理委员会指导下的基金经理小组负责制。

(2)投资管理程序

研究部和投资部通过国内外宏观经济分析、央行公开市场操作以及市场资金面等因素就货币市场利率进行预测，并向投资管理委员会提交投资策略报告，为本基金的投资管理提供决策依据。

投资管理委员会定期召开会议，并依据产品说明和研究结果确定各类资产配置。如遇重大事项，投资管理委员会及时召开临时会议做出决策。

基金经理小组根据投资管理委员会的决议，参考上述报告，并结合自身对货币市场的分析判断，形成基金投资计划并向交易部下达交易指令。

交易部依据指令制定交易策略，进行具体品种的交易。

研究部对投资组合进行事前、事中和事后的风险监控，并提出调整建议，报监察部、投资部和投资管理委员会。

4、其他资产的构成

序号	其他资产	金额(单位：人民币元)
1	交易保证金	0.00
2	应收证券清算款	0.00
3	应收利息	4,428,944.33
4	应收申购款	0.00
5	其他应收款	0.00
6	待摊费用	49,863.49
7	其他	0.00
	合计	4,478,807.82

六、开放式基金份额变动

序号	项目	份额(份)
1	期初基金份额总额	1,794,080,631.94
2	加：本期申购基金份额总额	2,500,808,415.22
3	减：本期赎回基金份额总额	3,320,489,656.16
4	期末基金份额总额	974,399,391.00

七、备查文件目录及查阅方式

(一)备查文件目录：

1、《中信现金优势货币市场基金基金合同》

2、《中信现金优势货币市场基金招募说明书》

3、报告期内中信现金优势货币市场基金在指定报刊上披露的各项公告的原稿

(二)查阅地点：

基金管理人办公地址：北京市朝阳区裕民路12号中国国际科技会展中心A座8层中信基金管理有限责任公司

基金托管人地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦 招商银行股份有限公司

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中信基金管理有限责任公司。

客户服务中心电话：010-82251898

基金管理人网址：funds.ecitic.com

基金管理人：中信基金管理有限责任公司

2006年10月25日

融通通利系列证券投资基金 2006年第三季度报告

第一节 重要提示

本系列开放式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。

本系列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。

本系列基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本系列基金合同规定，于2006年10月15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系列基金的招募说明书。

第二节 基金产品概况

(一)基金基本情况

基金简称：融通通利系列基金。其中：融通债券投资基金简称融通债券基金、融通深证100指数证券投资基金简称融通深证100指数基金、融通蓝筹成长证券投资基金简称融通蓝筹成长基金

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

期末基金份额总额：

融通债券基金	252,494,911.88份
融通深证100指数基金	604,354,382.94份
融通蓝筹成长基金	417,618,215.47份

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

(二)基金投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征

1、融通债券基金

投资目标：在强调本金安全的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。

投资策略：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。

业绩比较基准：全国银行间同业拆借中心编制的银行间债券综合指数。

风险收益特征：属于相对低风险的基金品种。

2、融通深证100指数基金

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。

3、融通蓝筹成长基金

投资目标：组合投资，资本增值，为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。

业绩比较基准：75%×国泰君安指数 + 25%×银行间债券综合指数。

风险收益特征：力求获得超过市场平均水平的收益，承担相应的风险。

第三节 主要财务指标和基金净值表现

重要提示：本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人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。

(一)主要财务指标(未经审计)

单位：人民币元

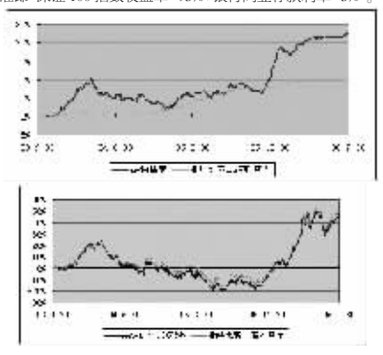
项目	2006年7月1日至2006年9月30日 融通债券基金	融通深证100指数基金	融通蓝筹成长基金
基金本期净收益	2,052,738.56	4,993,618.96	21,643,467.42
加权平均基金份额本期净收益	0.0076	0.0093	0.0524
期末基金资产净值	261,918,149.97	651,056,834.80	542,235,963.70
期末基金份额净值	1.037	1.077	1.298

(二)基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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
融通债券基金						
过去3个月	0.78%	0.06%	0.56%	0.08%	0.22%	-0.02%
融通深证100指数基金						
过去3个月	-0.41%	1.33%	0.25%	1.36%	-0.66%	-0.03%
融通蓝筹成长基金						
过去3个月	-2.04%	0.88%	-0.80%	1.03%	-1.23%	-0.15%

(三)累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势比较

注：上表中深证100指数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%”。



第四节 基金管理人报告

(一)本系列基金经理简介

陶武彬先生，融通债券基金基金经理，1971年出生，硕士学位，8年证券从业经验。曾先后在中国化工建设深圳公司、深圳市深投投资有限公司、香港京华山一证券公司从事证券研究、投资和投资银行等工作，2001年1月加入融通基金管理有限公司，历任行业研究员、研究部总监助理、融通新蓝筹基金经理助理等职。现同时任融通易支付货币市场证券投资基金基金经理。

张野先生，融通深证100指数基金基金经理，1962年出生，工商管理硕士，11年证券从业经验。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。现同时担任融通巨潮100指数证券投资基金基金经理。

易万军先生，融通蓝筹成长基金基金经理，1971年出生，中国科学技术大学少年班经济管理专业本科毕业，13年证券从业经验。历任中国科技国际信托投资公司武汉代表处股票自营负责人，鹏华基金管理公司基金交易员，上海华源集团恒盛投资管理公司投资总监，融通基金管理有限公司基金交易部总监。

(二)基金运作合规性说明

本报告期内，本系列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。

(三)基金运作报告

1、融通债券基金运作报告

2006年第三季度本基金取得0.78%的净值增长率，今年以来累计净值增长率为10.35%，今年以来现金分红每单位0.104元。

第三季度的中国债券市场呈现“山重水复疑无路，柳暗花明又一村”的走势。在中央银行连续收缩流动性，以及出其不意的加息措施重压下，债券市场一度绵绵下跌。在银行控制贷款规模后，大量资金需要配置在债券上，引发了对债券尤其是中长期债券的需求，新债招标不断压低的收益率带动了债券市场的恢复性反弹。根据北方之星统计，第三季度银行间债券市场微涨0.55%，上海交易所国债市场上涨0.98%。

本季度组合的主要调整依然体现了控制组合久期的思想，减持了上半年申购的长期企业债和部分交易所国债，增加了对部分质地优良的企业短期融资券(CP)的投资，此外，可转债的重新发行为基金经理提供了新的投资途径，对招商地产可转债(125024)的投资已经初见成效，未来有望继续为组合带来净值增长贡献。

感谢持有人对本基金的长期支持和信任，基金经理将本着勤勉尽职的原则，为持有人奉献更多的回报。

2、融通深证100指数基金运作报告

2006年第三季度中国资本市场进入了一个先抑后扬的巩固调整阶段(我们认为这是证券业的复苏期的后期特征。自2005年5月份股权分置改革为标志，行业拐点的出现而进入证券业的复苏期)。在宏观调控和信贷紧缩、IPO和再融资密集推出、小非流通股解冻流通以及部分获利的投资者变现上半年较大赢利等因素影响之下，上证综指最低跌至1541点。之后在招行H股发行、上市公司中报业绩普遍高于预期、中国金融期货交易所的挂牌，在银行、地产以及其他大盘蓝筹股等较低估值的股票带动下，股市开始稳步上扬。由于成份股风格特点上的区别、热点行业和板块在成份股中占比差别以及指数编制规则中对新上市股票的处理规则的不同，不同指数上的表现出现了较大的差距。三季度综合指数的类比中，采用新股上市直接进入指数成份股的上证指数涨幅为4.8%，深综A指的涨幅0.94%，两市成份股指数之间也拉开了较大的差距，上证50指数上半年涨幅为1.18%，深证100收益指数涨幅为0.22%。

把证券市场放到金融服务业中研究(证券业的周期性研究)，我们认为证券业已经完成了长达14个月的复苏期，证券行业的成长期已经来临。长期内由于股改对上市公司治理结构的改善、上市公司历史包袱的解除、与上市公司高管利益密切相关的考核机制的改变以及资金供给方面的结构性变化将给上市公司在二级市场上的表现带来深刻的影响。就第四季度我们预期：在渡过初期融资高峰和新股溢价效应带来的低潮后必将带来新的投资主题。价值与成长将成为市场的两条投资主线，在接近年底由于大量的基金募集带来的资金供给的持续增加，对装备制造，金融服务等行业的持续看好，同时大市值公司与大蓝筹公司在即将推出股指期货和融资融券等金融创新品种对大市值蓝筹股的刺激之下，会有更多的投资的机会。我们对第四季度证券市场的表现更为乐观。

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。我们的管理思想得到广大投资者的广泛的认同，在本季度内，基金份额增长了38%，由于基金份额的持续增长，本基金运用指数化投资方式，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。9月29日本基金股票投资部分的日跟踪误差为0.07%，第三季度，平均日跟踪误差为0.14%，严格控制在基金合同规定的0.5%的范围以内。上半年基金净值最终较好地拟合了目标指数的增长，有效地控制了指数基金相对目标指数的偏离风险。

3、融通蓝筹成长基金运作报告

第一、市场运行格局和操作回顾

承接证券市场上半年的牛市行情，尽管三季度宏观调控的心理阴影依旧存在，但对中国经济长期向好的信心以及投资者对投资机会的深入挖掘，市场的投资格局没有发生本质改变。

在此背景下市场呈现稳健上扬态势。市场投资机会进一步向事件推动型机会转移。比如围绕人民币加速升值带来的地产股投资机会、受到海外投资者认同带动的以招商银行为代表的金融类股投资机会、以及随着行业进一步向好带动的装备制造业投资机会等等。市场对事件推动的反应远大于对估值机会的反应，但季度末期对绩优大盘股票的追捧也预示着市场的年末行情将围绕估值与分红机会而展开。

从投资结果来看，本基金对市场的投资节奏把握并不十分准确，整体股票资产配置比重更多倾向于绩优分红类蓝筹股票，导致本基金季度表现一般。

第二、后市展望及对策

四季度证券市场面临良好的宏观环境。六中全会提出的构建社会主义和谐社会将长期利好于中国社会与经济的发展，本币升值步伐加快、流动性依旧泛滥以及宏观调恐力度放缓，经济景气周期延长等等为市场继续向好创造了良好的外部环境。从投资机会看，大盘绩优蓝筹类股票将非常突出。无论是估值优势、分红吸引力以及市场广泛关注的融资融券、股指期货等制度创新无不给这批股票带来非常正面的影响。如果市场发现对其中的部分行业基本面判断出现失误，进而从悲观转向乐观时，比如钢铁行业等将爆发出更大的投资机会。

第五节 投资组合报告

(一)融通债券基金投资组合报告

1、本报告期末基金资产组合情况

项目	金额(元)	占基金资产总值比例
银行存款和清算备付金	3,308,801.07	1.25%
债券投资市值	236,644,864.96	89.53%
资产支持证券市值	19,980,999.35	7.56%
其他资产	4,376,698.24	1.66%
资产合计	264,310,363.62	100.00%

2、本报告期末按券种分类的债券投资组合

债券种类	市值(元)	占基金资产净值比例
国债	110,019,189.60	42.01%
可转债	26,111,061.52	9.97%
企业债	97,458,540.84	37.21%
金融债	3,056,073.00	1.17%
合计	236,644,864.96	90.35%

3、本报告期末基金持有的资产支持证券情况

种类	市值(元)	占基金资产净值比例
资产支持证券	19,980,999.35	7.63%

4、本报告期末基金投资前五名债券明细

债券名称	市值(元)	占基金资产净值比例
02国债(4)	52,931,631.40	20.21%
06浙物产cp01	30,379,630.68	11.60%
21国债(3)	30,357,104.40	11.59%
06美锦cp01	30,269,940.00	11.56%
招商转债	22,859,061.52	8.73%

4、本报告期末基金投资资产支持证券明细

债券名称	市值(元)	占基金资产净值比例
澜电03	19,980,999.35	7.63%

5、投资组合报告附注

(1)本报告期内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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券；

(2)其他资产的构成

项目	金额(元)
应收交易保证金	11,725.49
应收利息	4,203,066.03
应收申购款	160,906.72
合计	4,376,698.24

(3)处于转股期的可转换债券明细

项目	债券名称	市值(元)	占基金资产净值比例
100726	华电转债	3,252,000.00	1.24%

(二)融通深证100指数基金投资组合报告

1、本报告期末基金资产组合情况

项目	金额(元)	占基金资产总值比例
银行存款和清算备付金	20,563,733.41	3.13%
股票投资市值	613,475,311.67	93.44%
债券投资市值	18,503,702.72	2.82%
权证投资市值	--	--
其他资产	4,026,592.72	0.61%
资产合计	656,569,340.52	100.00%

2、本报告期末按行业分类的股票投资组合

(1)指数投资部分

行业	市值(元)	占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	1,309,652.80	0.20%
B 采掘业	15,767,366.91	2.42%
C 制造业	340,651,435.45	52.32%
C0 食品、饮料	67,900,385.42	10.43%
C1 纺织、服装、皮毛	7,057,475.11	1.08%
C2 木材、家具	--	--
C3 造纸、印刷	3,983,637.63	0.61%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	38,948,167.49	5.98%
C5 电子	17,657,378.61	2.71%
C6 金属、非金属	96,583,408.47	14.83%
C7 机械、设备、仪表	75,375,260.57	11.58%
C8 医药、生物制品	29,571,160.25	4.54%
C99 其他制造业	3,574,561.90	0.55%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	24,714,697.76	3.80%
E 建筑业	5,085,834.62	0.78%
F 交通运输、仓储业	26,143,214.99	4.02%
G 信息技术业	45,935,037.02	7.06%
H 批发和零售贸易	22,309,917.15	3.43%
I 金融、保险业	25,160,258.40	3.86%
J 房地产业	75,741,932.99	11.63%
K 社会服务业	15,737,865.00	2.42%
L 传播与文化产业	5,032,489.50	0.77%
M 综合类	9,538,851.00	1.47%
合计	613,128,553.59	94.17%

(2)积极投资部分

行业	市值(元)	占基金资产净值比例
B 采掘业	119,265.24	0.02%
G 信息技术业	227,492.84	0.03%
合计	346,758.08	0.05%

3、本报告期末基金投资前五名股票明细

(1)指数投资部分				
股票代码	股票名称	数量(股)	市值(元)	占基金资产净值比例
000002	万科A	6,074,183	45,981,565.31	7.06%
000001	S深发展A	3,083,365	25,160,258.40	3.86%
000063	中兴通讯	781,498	24,984,491.06	3.84%
000858	五粮液	1,715,481	22,284,098.19	3.42%
000410	沈阳机床	1,143,554	16,284,208.96	2.50%
(2)积极投资部分				
股票代码	股票名称	数量(股)	市值(元)	占基金资产净值比例
002062	同洲电子	7,823	227,492.84	0.03%
601001	大同煤业	15,116	119,265.24	0.02%

4、本报告期末按券种分类的债券投资组合

债券种类	市值(元)	占基金资产净值比例
国债	16,269,127.60	2.50%
可转债	2,234,575.12	0.34%
合计	18,503,702.72	2.84%

5、本报告期末基金投资前五名债券明细

债券名称	市值(元)	占基金资产净值比例
04国债(11)	16,269,127.60	2.50%
招商转债	2,234,575.12	0.34%

6、投资组合报告附注

(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、处罚的证券；

(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；

(3)其他资产的构成

项目	金额(元)
应收交易保证金	1,665,961.30
应收利息	389,478.88
应收申购款	1,971,152.54
合计	4,026,592.72

(4)报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券；

(5)报告期内本基金无权证投资情况

(6)报告期内本基金未投资资产支持证券。

(三)融通蓝筹成长基金投资组合报告

1、本报告期末基金资产组合情况

项目	金额(元)	占基金资产总值比例
银行存款和清算备付金	72,407,553.85	13.28%
股票投资市值	324,947,685.64	59.62%
债券投资市值	116,435,333.70	21.36%
权证投资市值	--	--
其他资产	31,282,068.58	5.74%
资产合计	545,072,641.77	100.00%

2、本报告期末按行业分类的股票投资组合

项目	市值(元)	占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	--	--
B 采掘业	9,903,600.00	1.83%
C 制造业	223,845,830.56	41.28%
C0 食品、饮料	--	--
C1 纺织、服装、皮毛	--	--
C2 木材、家具	--	--
C3 造纸、印刷	--	--
C4 石油、化学、塑胶、塑料	33,698,836.00	6.21%
C5 电子	--	--
C6 金属、非金属	118,538,334.56	21.86%
C7 机械、设备、仪表	71,496,260.00	13.19%
C8 医药、生物制品	112,400.00	0.02%
C99 其他制造业	--	--
D 电力、煤气及水的生产和供应业	--	--
E 建筑业	--	--
F 交通运输、仓储业	--	--
G 信息技术业	7,136,697.28	1.32%
H 批发和零售贸易	50,721,560.00	9.35%
I 金融、保险业	33,339,997.80	6.15%
J 房地产业	--	--
K 社会服务业	--	--
L 传播与文化产业	--	--
M 综合类	--	--
合计	324,947,685.64	59.93%

3、本报告期末基金投资前十名股票明细

股票代码	股票名称	数量(股)	市值(元)	占基金资产净值比例
000709	G唐钢	14,880,000	51,633,600.00	9.52%
600058	G五矿	6,338,000	44,746,280.00	8.25%
000951	G重汽	3,852,000	43,527,600.00	8.03%
000898	G鞍钢	5,373,127	30,089,511.20	5.55%
600688	上海石化	4,572,600	28,350,120.00	5.23%
601988	中国银行	8,023,140	26,717,056.20	4.93%
600761	G合力	1,184,000	18,340,160.00	3.38%
000825	G太钢	1,663,238	10,312,075.60	1.90%
000933	G神火	1,260,000	9,903,600.00	1.83%
000629	G新钢钒	3,060,000	9,792,000.00	1.81%

4、本报告期末按券种分类的债券投资组合

债券种类	市值(元)	占基金资产净值比例
国债	116,435,333.70	21.47%
合计	116,435,333.70	21.47%

5、本报告期末基金投资前五名债券明细

债券名称	市值(元)	占基金资产净值比例
02国债(14)	116,435,333.70	21.47%

6、报告附注

(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、处罚的证券；

(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；

(3)其他资产的构成如下：

项目	金额(元)
交易保证金	1,000,436.10
应收证券清算款	27,302,713.00
应收利息	2,892,607.89
应收申购款	86,311.59
合计	31,282,068.58

(4)本报告期末基金未持有处于转股期的可转换债券；

(5)报告期内本基金未投资权证；

(6)报告期内本基金未投资资产支持证券。

第六节 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通债券基金	融通深证100指数基金	融通蓝筹成长基金
期初基金份额	287