

# 融通通利系列证券投资基金之融通蓝筹成长证券投资基金 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基金通融蓝筹成长证券投资基金(以下简称“本基金”)2010 年半年度报告摘要。  
 基金管理人、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预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前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。  
 本报告自2010年1月1日起至6月30日止。

**§2 基金简介**

基金名称	融通蓝筹成长混合
基金代码	161605
交易代码	161605 (前端收费模式)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009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	2,188,710,835.67份
基金合同存续期	不定期

**2.2 基金产品说明**  
**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,同时更重视基本分析,重点精选基本面良好的个股。  
**业绩比较基准:** 沪深300 指数收益率\*75%+中债综合指数收益率\*25%。  
**风险收益特征:** 力求超越市场平均水平的收益,承担相应的风险。  
 注:为使更好的与其他同类基金进行业绩比较,经基金管理人与基金托管人协商一致,本基金的业绩比较基准变更为“沪深300 指数收益率\*75%+中债综合指数收益率\*25%”,详见基金管理人于2010年2月6日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》上发布的《融通基金管理有限公司关于变更旗下部分基金业绩比较基准的公告》。

**2.3 基金管理人、基金托管人**

姓名	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
法定代表人	吴永平	蒋松文
信息披露负责人	联系电话: 0755 26948666 电子邮箱: service@mfund.com.cn	010 66105799 custo@icbc.com.cn
客户服务电话	400-883-8088、0755 26948088	95588
传真	0755 26933005	010 66105798

**2.4 信息披露方式**  
 本基金半年度报告正文的互联网网址: <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 主要财务数据和基金净值表现**

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	报告期末 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
本期已实现收益	101,378,824.47
本期利润	-367,147,413.41
加权平均基金份额本期利润	-0.1636
本基金份额净值增长率	-12.48%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末 2010 年 6 月 30 日
期末可供分配基金份额利润	0.1495
期末基金资产净值	2,516,029,394.28
期末基金份额净值	1.150

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	业绩比较基准收益率②	①-②	③-④	④-⑤	
过去一个月	-5.12%	0.79%	-5.67%	1.25%	0.55%	-0.46%
过去三个月	-9.31%	1.03%	-17.70%	1.37%	8.39%	-0.34%
过去六个月	-12.48%	0.95%	-21.30%	1.20%	8.82%	-0.25%
过去一年	-6.90%	1.33%	-10.85%	1.38%	3.68%	-0.05%
过去三年	-3.03%	1.61%	-11.89%	1.77%	8.86%	-0.16%
自基金合同生效起至今	192.79%	1.34%	83.80%	1.49%	106.99%	-0.15%

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(含)日之前采用“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%+中债综合指数收益率\*25%”。

**3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩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**

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。  
 估值委员会定期对环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生重大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。基金在采用新估值政策或投资新品种时,应评价现有估值政策和程序的适用性。其中,基金管理人应定期对环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生重大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,登记清算部履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允价值、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、事中和事后的审核工作。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,截至报告期末公司与外部估值服务机构签约。  
 4.7 管理人对于报告期内基金净值分配情况的说明  
 本基金本报告期末未进行利润分配,符合相关法律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蓝筹成长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,融通蓝筹成长证券投资基金的管理人——融通基金管理有限公司在融通蓝筹成长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、基金费用开支等方面,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面运作严格按照基金合同的规定进行。报告期内,融通蓝筹成长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内容的真实、准确和完整发表意见**  
 基金管理人依法对融通基金管理有限公司编制和披露的融通蓝筹成长证券投资基金2010 年半年度报告中财务数据、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:融通蓝筹成长证券投资基金  
 报告截止日:2010年6月30日

资产		期末 2010年6月30日	上年度末 2009年12月31日
流动资产:			
银行存款	319,731,054.89	84,666,663.82	
结算备付金	3,301,750.40	2,849,839.47	
存出保证金	2,114,312.76	1,098,780.49	
交易性金融资产	2,086,172,089.42	2,932,766,003.58	
其中:股票投资	1,098,050,458.42	2,262,179,003.58	
基金投资	-	-	
债券投资	988,121,631.00	670,587,000.00	
资产支持证券投资	-	-	
衍生金融资产	-	-	
买入返售金融资产	100,000,350.00	-	
应收利息	-	38,261,131.44	
应收股利	14,234,129.54	11,626,185.41	
应收申购款	-	-	
应收证券清算款	-	-	
其他应收款	740,538.01	890,424.72	
其他资产	-	-	
资产总计	2,526,294,225.02	3,072,159,028.93	

负债和所有者权益		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	-	-	
应付短期融资款	-	-	
应付账款	1,806,594.39	6,924,160.69	
应付销售人员薪酬	3,234,830.75	3,961,190.36	
应付托管费	539,138.45	660,198.41	
应付销售服务费	-	-	
应付交易费用	2,327,042.21	1,632,128.04	
应交税费	1,249,200.00	1,249,200.00	
应付利息	-	-	
应付股利	-	-	
递延所得税负债	-	-	
其他负债	1,108,019.94	1,123,791.71	
负债合计	10,264,830.74	42,117,795.99	
所有者权益:			
实收基金	2,188,710,835.67	2,305,561,205.26	
未分配利润	327,318,558.61	724,480,027.68	
所有者权益合计	2,516,029,394.28	3,030,041,232.94	
负债和所有者权益总计	2,526,294,225.02	3,072,159,028.93	

注:报告截止日2010年6月30日,基金份额净值1.150元,基金份额总额2,188,710,835.67份。  
**6.2 利润表**  
 会计主体:融通蓝筹成长证券投资基金  
 本报告期:2010年1月1日至2010年6月30日

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		-333,738,077.86	1,154,507,330.82
1.利息收入	11,993,198.40	15,383,985.41	
其中:存款利息收入	996,174.95	864,188.69	
债券利息收入	10,670,685.32	14,519,796.72	
资产支持证券利息收入	-	-	
公允价值变动损益	326,338.13	-	
其他收入	-	-	
2.投资收益	122,726,101.42	-188,174,415.36	
其中:股权投资收益	120,637,460.06	-192,011,622.95	
基金投资收益	-	-	
债券投资收益	-1,813,600.00	-7,777,871.97	
资产支持证券投资收益	-	-	
衍生工具收益	-	-	
股利收益	3,902,241.36	11,615,079.56	
公允价值变动收益	-468,526,237.88	1,327,118,618.6	
3.汇兑收益	-	-	
5.其他收入	68,860.20	179,142.17	
减:二、费用	33,409,335.55	35,918,220.62	
1.管理费用	20,769,259.3	23,655,829.90	
2.托管费	3,461,543.19	3,942,638.15	
3.销售服务费	-	-	
4.交易费用	9,065,287.42	8,205,930.34	
5.利息支出	-	-	
6.其他费用	113,245.64	113,823.04	
三、利润总额	-367,147,413.41	1,118,589,110.20	
减:所得税费用	-	-	
净利润	-367,147,413.41	1,118,589,110.20	

**6.3 所有者权益(基金净值)变动表**  
 会计主体:融通蓝筹成长证券投资基金  
 本报告期:2010年1月1日至2010年6月30日

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、期初所有者权益(基金净值)		2,305,561,205.26	3,030,041,232.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)		-367,147,413.41	-367,147,413.41
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数		-116,850,389.59	-30,014,055.66
其中:基金申购款		66,690,502.60	16,765,572.30
2.基金赎回款		-183,540,872.19	-46,779,627.96
四、本期所有者权益(基金净值)变动数		-2,188,710,835.67	-327,318,558.61
五、期末所有者权益(基金净值)		2,188,710,835.67	2,516,029,394.28

**6.4 管理人对于报告期内基金净值分配情况的说明**  
 2010 年上半年,本基金托管人在对融通蓝筹成长证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他相关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。  
**6.5 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,融通蓝筹成长证券投资基金的管理人——融通基金管理有限公司在融通蓝筹成长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、基金费用开支等方面,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面运作严格按照基金合同的规定进行。报告期内,融通蓝筹成长证券投资基金未进行利润分配。  
**6.6 托管人对半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见**  
 基金管理人依法对融通基金管理有限公司编制和披露的融通蓝筹成长证券投资基金2010 年半年度报告中财务数据、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。

**6.4.1 关联方关系**

关联方名称	2010年1月1日至2010年6月30日	2009年1月1日至2009年6月30日		
成交金额	占当期佣金的比例(%)	成交金额	占当期佣金的比例(%)	
融通达利	-	-	115,640,130.82	2.15

**6.4.1.2 关联交易**  
 注:上述数据按市值比例计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证券交易和经手费后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究和市场分析信息服务等。  
**6.4.1.2.1 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	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	2,769,259.30	23,655,829.90
其中:支付给销售机构的客户维护费	2,518,213.74	2,756,769.19

注:支付基金管理人融通基金管理有限公司的管理费按照前一日基金资产净值1.50%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×1.50%÷当年天数。  
**6.4.1.2.2 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	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	3,461,543.19	3,942,638.15

注:支付基金管理人中国工商银行的托管费按照前一日基金资产净值0.25%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×0.25%÷当年天数。  
**6.4.1.3 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。  
**6.4.1.4 各关联方投资本基金的情况**  
**6.4.1.4.1 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。  
**6.4.1.4.2 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。  
**6.4.1.5 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	2009年1月1日至2009年6月30日		
期末余额	当期利息收入	当期利息收入		
中国工商银行	319,731,054.89	967,773.12	215,025,592.71	830,639.94

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。  
**6.4.1.6 本基金在承销期间参与关联方承销的情况**  
 1.本基金本报告期及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间内任副主承销商或分销商所承销的证券。  
 2.本基金本报告期及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)在承销期间承销的证券。  
**6.4.1.7 其他关联交易事项的说明**  
 无。  
**6.4.2 期末2010年6月30日**本基金持有的流通受限证券  
**6.4.2.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**  
 单位:人民币元

证券代码	证券名称	认购日期	成功认购日	可流通日	限售类型	期末持仓数量(股)	期末持仓成本(元)	期末公允价值(元)	备注		
600060	海信电器	2009-12-25	2010-12-24	非公开发行	限售	18,38	12,05	1,800,000	27,570,000.00	18,075,000.00	-
600060	海信电器	2010-5-12	2010-12-24	非公开发行	限售	12,05	750,000	-	-	9,037,500.00	-

注:1.本基金于2009年12月25日认购海信电器非公开发行股票,认购数量1,500,000股,认购单价18.38元。2010年5月14日,海信电器实施2009年度资本公积金每10股转增5股分红方案。  
 2.本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认购投资者参与网下申购的新股,根据基金与上市公司所签订的认购协议的约定,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协议的新股,从新股上市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》规范的非公开发行股票,所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。  
 3.本基金本报告期未有其他类别的认购新发/增发证券而流通受限证券。  
**6.4.2.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**  
 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	复牌参考价格	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601318	中国平安	2010-6-29	重大资产重组	44.55	-	1,499,989	71,598,512.91	66,824,509.95	-
000895	双汇发展	2010-3-22	资产重组	43.59	-	999,904	58,171,006.90	43,585,815.36	-

**6.4.2.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**  
**6.4.2.3.1 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。  
**6.4.2.3.2 交易所市场债券正回购**  
 本报告期末,本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

金额单位:人民币元

本期 2010年1月1日至2010年6月30日		上期可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日	
当期佣金	占当期佣金总额的比例(%)	期末未付佣金余额	占期末未付佣金总额的比例(%)
融通达利	-	-	-

注:上述数据按市值比例计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证券交易和经手费后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究和市场分析信息服务等。  
**6.4.2.2 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	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	2,769,259.30	23,655,829.90
其中:支付给销售机构的客户维护费	2,518,213.74	2,756,769.19

注:支付基金管理人融通基金管理有限公司的管理费按照前一日基金资产净值1.50%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×1.50%÷当年天数。  
**6.4.2.2.2 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	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	3,461,543.19	3,942,638.15

注:支付基金管理人中国工商银行的托管费按照前一日基金资产净值0.25%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×0.25%÷当年天数。  
**6.4.2.3 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。  
**6.4.2.4 各关联方投资本基金的情况**  
**6.4.2.4.1 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。  
**6.4.2.4.2 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。  
**6.4.2.5 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	2009年1月1日至2009年6月30日		
期末余额	当期利息收入	当期利息收入		
中国工商银行	319,731,054.89	967,773.12	215,025,592.71	830,639.94

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。  
**6.4.2.6 本基金在承销期间参与关联方承销的情况**  
 1.本基金本报告期及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间内任副主承销商或分销商所承销的证券。  
 2.本基金本报告期及上年度可比期间均未买入管理人、托管人的主要股东(非