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年年度报告摘要

2010年 12 月 31 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:2011 年 3 月 29 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。本年度报告摘要为融通通利系列证券投资基金之子基金融通蓝筹成长证券投资基金(以下简称"本基金")2010 年年度报告摘要。

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 2011 年 3 月 25 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告中的财务资料已经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	融通蓝筹成长混合	
基金主代码	161605	
交易代码	161605(前端收费模式)	161655(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	1,942,408,387.34 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,同时更重视基本面分析,强调通过基本面分析挖掘个股。
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	力求获得超过市场平均水平的收益,承担相应的风险。

注:为便于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%+中信标普全债指数收益率×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	涂卫东	赵会军
	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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2010 年	2009 年	2008 年
本期已实现收益	276,578,043.80	176,063,443.46	138,678,711.58
本期利润	-165,021,112.57	1,338,201,930.99	-3,231,983,490.51
加权平均基金份额本期利润	-0.0763	0.5154	-0.9903
本期基金份额净值增长率	-6.01%	50.59%	-49.60%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
期末可供分配基金份额利润	0.2354	0.3142	-0.0453
期末基金资产净值	2,399,554,487.97	3,030,041,232.94	2,820,564,643.90
期末基金份额净值	1.235	1.314	0.955

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
过去三个月	-6.44%	1.40%	4.60%	1.33%	-11.04%	0.07%
过去六个月	7.39%	1.17%	16.17%	1.17%	-8.78%	0.00%
过去一年	-6.01%	1.07%	-8.57%	1.19%	2.56%	-0.12%
过去三年	-28.66%	1.50%	-20.92%	1.73%	-7.74%	-0.23%
过去五年	176.81%	1.48%	170.80%	1.62%	6.01%	-0.14%
自基金合同生效起至今	214.44%	1.33%	115.86%	1.47%	98.58%	-0.14%

注:本基金业绩比较基准项目分段计算,其中:2009 年 12 月 31 日(含此日)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

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2010	-	-	-	-	-
2009	1.200	99,778,177.20	162,237,358.63	262,015,535.83	-
2008	-	-	-	-	-
合计	1.200	99,778,177.20	162,237,358.63	262,015,535.83	-

§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 12 月 31 日,公司管理的基金共有十只,一只封闭式基金:融通通乾封闭基金,九只开放式基金: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)、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		
严菲	本基金的基金经理	2007 年 3 月 2 日	-	8	经济学硕士,具有证券从业资格。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。
陈晓生	本基金的基金经理、融通动力先锋股票基金基金经理、融通内需驱动股票基金基金经理、公司总经理助理。	2007 年 3 月 2 日	-	16	经济学硕士,具有证券从业资格。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、股票投资经理助理、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基金经理助理、机构理财部投资经理、副总监。

注:(1)任职日期和离任日期均指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。

(2)自 2011 年 3 月 24 日起,陈晓生先生因专门负责公司机构理财业务,不再担任本基金的基金经理,严菲女士继续担任本基金的基金经理。

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》上刊登的相关公告。

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

本报告期,本基金与公司管理的投资风格相似的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
融通新蓝筹混合基金	-1.25%
本基金	-6.01%

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

2010 年市场不同板块表现出现较大分化,上证综合指数下跌 14.31%,沪深 300 指数下跌 12.51%,而中小板综指上涨 28.38%。市场全年处于宏观政策收紧的预期中,央行多次上调存款准备金率回收流动性、政府对房地产行业的调控、以及下半年通胀走势超预期,央行加息,导致对宏观政策敏感的周期性行业全年基本表现平淡,有稳定增长预期的医药消费类行业以及符合经济转型的新兴战略行业则受到市场资金追捧。蓝筹成长基金投资策略是控制仓位、精选个股,通过控制股票仓位规避市场的系统性风险,但同时重点配置了稳定增长的医药消费行业,但在四季度蓝筹成长基金在中游上配置较多,负贡献较大。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金份额净值增长率为-6.01%,业绩比较基准收益率为-8.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2011 年,市场受内外部两大因素影响,国内市场,通胀的不确定性、相机抉择的货币政策和宏观调控政策加大了市场波动的可能性;外部环境,美国经济的复苏进程影响货币政策松紧、美元走势和全球资金流向。资金方面,流动性整体呈收缩态势,市场波动性风险加大;市场扩容继续,中小板和创业板的估值会下降。行业方面,长期看好消费新兴产业;但关注低估值周期性行业的阶段性机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

基金管理人坚持一切从保护基金持有人利益出发,继续致力于内控制度与机制的完善,加强合规控制与风险防范,确保基金运作符合法律法规和基金合同的要求。公司监察稽核部门通过合规审核、实时监控及专项检查等方法,对基金运作和公司管理进行独立的监察稽核,及时发现风险隐患,提出整改建议,并督促跟踪业务部门进行整改。

在专项稽核方面,公司监察稽核部门针对不同业务环节的风险特点,制定年度检查计划,并结合对各风险点风险程度的实时判断和评估,按照不同的检查频率,对投资决策、研究支持、交易执行、基金销售、后台运营、信息披露及员工职业操守管理等方面的重点业务环节进行专项检查,检查有关业务执行的合规性和风险控制措施的有效性,检查项目覆盖了相关业务的主要风险点。本报告期内,特别加大了对投资管理人员管控措施、投资决策流程及决策依据、交易执行及后台运作风险等敏感、重点项目的关注,确保基金运作的稳健合规。本基金管理人全年未发生合规及风险事故。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、本基金于本报告期内未进行利润分配;

2、本基金管理人于 2011 年 1 月 12 日实施利润分配,以 2010 年 12 月 31 日的可分配收益为基准,每 10 份基金份额派发现金红利 0.30 元。

§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,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,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,融通蓝筹成长证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本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蓝筹成长证券投资基金 2010 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 审计报告

本基金 2010 年年度财务会计报告已经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告(普华永道中天审字(2011)第 20205 号),投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位:人民币元

资 产	本期末 2010年 12 月 31 日	上年度末 2009年 12 月 31 日
资 产:		
银行存款	368,610,174.68	84,666,663.82
结算备付金	10,337,353.31	2,849,839.47
存出保证金	1,762,241.93	1,098,780.49
交易性金融资产	2,024,243,984.50	2,932,766,003.58
其中:股票投资	1,494,292,984.50	2,262,179,003.58
基金投资	-	-
债券投资	529,951,000.00	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	-	-
应收证券清算款	-	38,261,131.44
应收利息	16,118,608.55	11,626,185.41
应收股利	-	-
应收申购款	312,826.48	890,424.72
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,421,385,189.45	3,072,159,028.93
负债和所有者权益	本期末 2010年 12 月 31 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	8,813,573.75	26,567,180.78
应付赎回款	1,556,064.49	6,924,106.69
应付管理人报酬	3,163,898.73	3,961,190.36
应付托管费	527,316.45	660,198.41
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	5,414,134.30	1,632,128.04
应交税费	1,249,200.00	1,249,200.00
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,106,513.76	1,123,791.71
负债合计	21,830,701.48	42,117,795.99
所有者权益:		
实收基金	1,942,408,387.34	2,305,561,205.26
未分配利润	457,146,100.63	724,480,027.68
所有者权益合计	2,399,554,487.97	3,030,041,232.94
负债和所有者权益总计	2,421,385,189.45	3,072,159,028.93

注:报告截止日 2010 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.235 元,基金份额总额 1,942,408,387.34 份

7.2 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 12 月 31 日

单位:人民币元

项 目	本期 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
一、收入	-94,050,056.39	1,409,459,653.85
1.利息收入	25,049,205.64	27,797,984.91
其中:存款利息收入	1,813,506.19	1,293,284.64
债券利息收入	22,830,225.42	26,504,700.27
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	405,474.03	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益	322,376,249.56	219,072,353.58
其中:股票投资收益	315,271,797.44	216,229,666.86
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-2,671,126.58	-11,323,654.14
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	9,775,578.70	14,166,340.86
3.公允价值变动收益	-441,599,156.37	1,162,138,487.53
4. 汇兑收益	-	-
5.其他收入	123,644.78	450,827.83
减:二、费用	70,971,056.18	71,257,722.86
1.管理人报酬	40,689,645.49	48,580,295.95
2.托管费	6,781,607.55	8,096,716.02
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	23,275,300.14	14,310,475.54
5.利息支出	-	46,848.80
其中:卖出回购金融资产支出	-	46,848.80
6.其他费用	224,503.00	223,386.55
三、利润总额	-165,021,112.57	1,338,201,930.99
减:所得税费用	-	-
四、净利润	-165,021,112.57	1,338,201,930.99

7.3 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 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 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)	2,305,561,205.26	724,480,027.68	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)	-	-165,021,112.57	-165,021,112.57
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-363,152,817.92	-102,312,814.48	-465,465,632.40
其中:1.基金申购款	120,775,882.22	31,332,601.80	152,108,484.02
2.基金赎回款	-483,928,700.14	-133,645,416.28	-617,574,116.42
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)	1,942,408,387.34	457,146,100.63	2,399,554,487.97
项目	上年度可比期间 2009年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 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)	2,954,503,759.78	-133,939,115.88	2,820,564,643.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,338,201,930.99	1,338,201,930.99
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-648,942,554.52	-217,767,251.60	-866,709,806.12
其中:1.基金申购款	344,394,172.97	86,147,697.39	430,541,870.36
2.基金赎回款	-993,336,727.49	-303,914,948.99	-1,297,251,676.48
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-262,015,535.83	-262,015,535.83
五、期末所有者权益(基金净值)	2,305,561,205.26	724,480,027.68	3,030,041,232.94

注:后附 7.4 报表附注为本财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

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

7.4 报表附注

7.4.1 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。

7.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错和更正金额。

7.4.3 关联方关系

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
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
日兴资产管理有限公司	基金管理人股东

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。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2009年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 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	2,868,802,350.50	18.99	132,458,178.94	1.44

7.4.4.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 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	2,330,921.96	18.49	1,834,766.81	33.89
关联方名称	上年度可比期间 2009年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 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	107,625.46	1.40	13,664.75	0.84

注:上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费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成果和市场信息服务等。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	40,689,645.49	48,580,295.95
其中:支付给销售机构的客户维护费	4,962,981.50	5,769,845.14

注:支付基金管理人融通基金管理有限公司的管理费按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。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	6,781,607.55	8,096,716.02

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按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。

7.4.4.3 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均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度本基金管理人均未投资于本基金。

7.4.4.4.2 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,本基金管理人主要股东及其控制的机构均未投资于本基金。

7.4.4.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2009年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 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	368,610,174.68	1,736,651.12	84,666,663.82	1,242,194.74

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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.5 期末(2010 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 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

7.4.5.1.1 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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600166	福田汽车	2010-9-16	2011-9-14	非公开发行	18.06	19.85	1,000,000	18,060,000.00	19,850,000.00	-

注: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或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,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获配的新股,从新股获配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。

7.4.5.2 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
600518	康美药业	2010-12-28	配股	19.71	2011-1-6	17.29	1,000,000	6,976,296.67	19,710,000.00	-

注:本基金截至 2010 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 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。

7.4.5.3.2 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	1,494,292,984.50	61.71
	其中:股票	1,494,292,984.50	61.71
2	固定收益投资	529,951,000.00	21.89
	其中:债券	529,951,000.00	21.89
	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	378,947,527.99	15.65
6	其他各项资产	18,193,676.96	0.75
7	合计	2,421,385,189.45	100.00

8.2 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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	991,934,114.31	41.34
C0	食品、饮料	201,053,638.90	8.38
C1	纺织、服装、皮毛	30,357,460.80	1.27
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	49,300,000.00	2.05
C5	电子	81,966,078.92	3.42
C6	金属、非金属	45,980,000.00	1.92
C7	机械、设备、仪表	321,281,055.73	13.39
C8	医药、生物制品	220,939,750.38	9.21
C99	其他制造业	41,056,129.58	1.71
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	19,798,138.80	0.83
F	交通运输、仓储业	34,200,000.00	1.43
G	信息技术业	58,966,465.31	2.46
H	批发和零售贸易	43,648,108.20	1.82
I	金融、保险业	175,940,000.00	7.33
J	房地产业	68,706,386.00	2.86
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	23,959,113.48	1.00
M	综合类	77,140,658.40	3.21
	合计	1,494,292,984.50	62.27

8.3 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	600887	伊利股份	2,799,800	107,120,348.00	4.46
2	601318	中国平安	1,500,000	84,240,000.00	3.51
3	000650	仁和药业	3,499,749	80,144,252.10	3.34
4	000009	中国宝安	4,599,920	77,140,658.40	3.21
5	600267	海正药业	1,807,808	69,564,451.84	2.90
6	600166	福田汽车	3,000,000	68,410,000.00	2.85
7	000425	徐工机械	999,974	57,198,512.80	2.38
8	000651	格力电器	2,999,858	54,387,425.54	2.27
9	601166	兴业银行	2,000,000	48,100,000.00	2.00
10	000039	中集集团	2,000,000	45,980,000.00	1.92

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)的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	601318	中国平安	321,318,213.08	10.60
2	601166	兴业银行	281,981,534.50	9.31
3	600036	招商银行	193,184,840.68	6.38
4	000858	五 粮 液	162,725,462.57	5.37
5	600015	华夏银行	162,689,081.12	5.37
6	000933	神火股份	150,793,024.46	4.98
7	601111	中国国航	147,488,753.62	4.87
8	600000	浦发银行	139,425,818.31	4.60
9	600887	伊利股份	136,672,631.24	4.51
10	600690	青岛海尔	129,038,352.99	4.26
11	000422	湖北宜化	126,973,511.36	4.19
12	600104	上海汽车	126,880,390.11	4.19
13	600067	冠城大通	125,770,802.55	4.15
14	600425	青松建化	125,487,181.21	4.14
15	600266	北京城建	122,608,303.76	4.05
16	000009	中国宝安	114,176,439.93	3.77
17	601169	北京银行	112,596,271.64	3.72
18	600115	东方航空	103,481,515.85	3.42
19	000651	格力电器	103,311,458.59	3.41
20	000951	中国重汽	102,512,397.97	3.38
21	000425	徐工机械	97,936,122.40	3.23
22	600048	保利地产	95,832,142.99	3.16
23	600029	南方航空	93,836,342.06	3.10
24	000877	天山股份	91,742,325.76	3.03
25	601601	中国太保	87,090,027.01	2.87
26	600498	烽火通信	86,288,136.46	2.85
27	000550	江铃汽车	84,906,783.09	2.80
28	000650	仁和药业	82,605,790.72	2.73
29	600739	辽宁成大	80,747,618.99	2.66
30	002029	七 匹 狼	79,790,774.02	2.63
31	000729	燕京啤酒	79,450,274.38	2.62
32	600468	百利电气	77,063,345.92	2.54
33	002241	歌尔声学	75,746,533.17	2.50
34	000060	中金岭南	75,001,582.19	2.48
35	600267	海正药业	74,833,703.20	2.47
36	600096	云天化	71,954,824.91	2.37
37	600993	马应龙	70,470,724.73	2.33
38	600750	江中药业	70,354,687.63	2.32
39	601699	潞安环能	66,849,051.40	2.21
40	002269	美邦服饰	64,130,418.50	2.12
41	000800	一汽轿车	62,724,699.18	2.07

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。

8.4.2 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	601318	中国平安	338,817,264.35	11.18
2	601166	兴业银行	294,549,626.18	9.72
3	600036	招商银行	268,664,877.37	8.87
4	600690	青岛海尔	187,225,771.74	6.18
5	601111	中国国航	183,451,992.25	6.05
6	600518	康美药业	172,564,729.39	5.70
7	600000	浦发银行	166,153,789.35	5.48
8	000858	五 粮 液	163,461,419.81	5.39
9	000951	中国重汽	153,181,836.78	5.06
10	600067	冠城大通	139,886,892.63	4.62
11	600425	青松建化	137,487,981.30	4.54
12	000538	云南白药	128,819,666.55	4.25
13	000933	神火股份	128,501,969.73	4.24
14	600104	上海汽车	124,229,096.57	4.10
15	600266	北京城建	121,019,123.54	3.99
16	601169	北京银行	120,343,375.72	3.97
17	600029	南方航空	119,116,503.64	3.93
18	000422	湖北宜化	117,192,167.28	3.87
19	600015	华夏银行	116,686,290.80	3.85
20	000651	格力电器	115,500,003.90	3.81
21	000063	中兴通讯	113,698,686.89	3.75
22	000001	深发展 A	109,585,011.43	3.62
23	600739	辽宁成大	107,199,510.87	3.54
24	600750	江中药业	96,042,871.65	3.17
25	600115	东方航空	94,921,962.08	3.13
26	000425	徐工机械	94,566,903.80	3.12
27	000877	天山股份	93,286,488.97	3.08
28	601601	中国太保	92,223,965.52	3.04
29	000800	一汽轿车	88,090,395.62	2.91
30	600498	烽火通信	83,214,296.92	2.75
31	000729	燕京啤酒	81,675,162.54	2.70
32	600096	云天化	81,427,288.29	2.69
33	002024	苏宁电器	79,216,356.83	2.61
34	600031	三一重工	79,157,531.87	2.61
35	000002	万　科 A	78,217,763.58	2.58
36	600468	百利电气	78,051,389.41	2.58
37	000527	美的电器	76,357,692.85	2.52
38	000060	中金岭南	75,145,913.69	2.48
39	600303	曙光股份	70,434,845.79	2.32
40	002029	七 匹 狼	70,057,259.00	2.31
41	000550	江铃汽车	68,821,269.24	2.27
42	002241	歌尔声学	68,247,426.29	2.25
43	601699	潞安环能	68,201,935.94	2.25
44	600993	马应龙	65,321,568.88	2.16
45	600048	保利地产	63,510,222.92	2.10

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。

8.4.3 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	7,240,882,362.53
卖出股票收入(成交)总额	7,890,491,182.68

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。

8.5 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	430,101,000.00	17.92
3	金融债券	99,850,000.00	4.16
	其中:政策性金融债	99,850,000.00	4.16
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	529,951,000.00	22.09

8.6 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0801041	08央行票据 41	1,000,000	100,340,000.00	4.18
2	0801035	08央行票据 35	1,000,000	100,290,000.00	4.18
3	060205	06国开 05	1,000,000	99,850,000.00	4.16
4	0801017	08央行票据 17	800,000	80,096,000.00	3.34
5	0801062	08央行票据 62	500,000	50,240,000.00	2.09

8.7 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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 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	1,762,241.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,118,608.55
5	应收申购款	312,826.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,193,676.96

8.9.4 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。

8.9.5 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	19,850,000.00	0.83	非公开发行

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
126,141	15,398.71	7,519,972.68	0.39%	1,934,888,414.66	99.61%

9.2 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	533,661.35	0.0275%

§10 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	766,073,014.14
本报告期期初基金份额总额	2,305,561,205.26
本报告期基金总申购份额	120,775,882.22
减:本报告期基金总赎回份额	483,928,700.14
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,942,408,387.34

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

11.2.1 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。

4、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。

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。

5、自 2011 年 3 月 24 日起,陈晓生先生因专门负责公司机构理财业务,不再担任本基金的基金经理,严菲女士继续担任本基金的基金经理。

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》上刊登的相关公告。

11.2.2 基金托管人的重大变动

经证监会审批,晏秋生任资产托管部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所有限公司,该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今,本年度应支付的审计费用为 100,000.00 元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
招商证券	2	4,032,622,476.98	26.70%	3,341,678.67	26.50%	-
新时代证券	1	2,868,802,350.50	18.99%	2,330,921.96	18.49%	-
海通证券	1	2,804,327,931.71	18.57%	2,383,667.44	18.90%	-
齐鲁证券	1	2,531,266,554.10	16.76%	2,151,568.63	17.06%	-
中金公司	1	1,944,873,103.70	12.88%	1,653,133.66	13.11%	-
华泰联合证券	1	921,402,461.90	6.10%	748,647.78	5.94%	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	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、本报告期内基金租用交易单元无变更。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	19,842,036.10	100.00%	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

融通基金管理有限公司
二〇一一年三月二十九日