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：2012年3月26日

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

2011年度报告摘要

2011年12月31日

§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"）2011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20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2011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	1，787，498，676.87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。

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	2011年	2010年	2009年
本期已实现收益	-397，251，981.11	276，578，043.80	176，063，443.46
本期利润	-425，542，161.98	-165，021，112.57	1，338，201，930.99
加权平均基金份额本期利润	-0.2291	-0.0763	0.5154
本期基金份额净值增长率	-19.03%	-6.01%	50.59%
3.1.2 期末数据和指标	2011年末	2010年末	2009年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0246	0.2354	0.3142
期末基金资产净值	1，743，555，686.20	2，399，554，487.97	3，030，041，232.94
期末基金份额净值	0.975	1.235	1.314

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）。

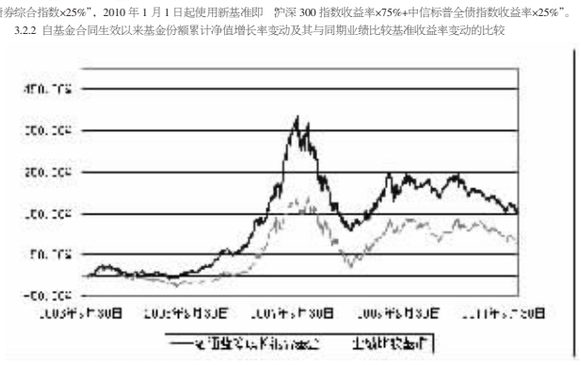
3.2 基金净值表现

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

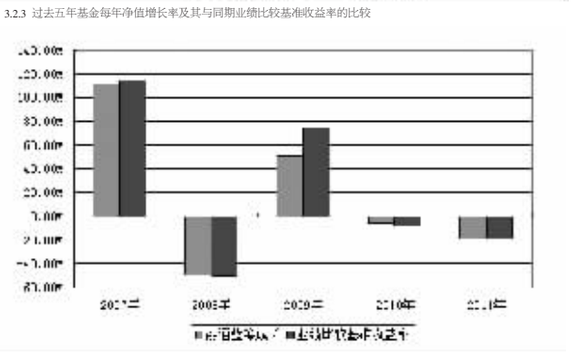
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.81%	0.87%	-6.20%	1.06%	5.39%	-0.19%
过去六个月	-11.92%	0.84%	-17.08%	1.02%	5.16%	-0.18%
过去一年	-19.03%	0.82%	-18.35%	0.98%	-0.68%	-0.16%
过去三年	14.60%	1.17%	29.92%	1.24%	-15.32%	-0.07%
过去五年	22.41%	1.45%	38.78%	1.60%	-16.37%	-0.15%
自基金合同生效起至今	154.60%	1.28%	76.24%	1.42%	78.36%	-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



3.3 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
2011	0.300	21，352，144.53	36，743，662.93	58，095，807.46	-
2010	-	-	-	-	-
2009	1.200	99，778，177.20	162，237，358.63	262，015，535.83	-
合计	1.500	121，130，321.73	198，981，021.56	320，111，343.29	-

§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12月31日，公司管理的基金共有十二只，一只封闭式基金，即融通通乾封闭基金，十一只开放式基金，即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 基金经理小组简介

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	-	9	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	2011年3月24日	17	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、总经理助理。

注：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。

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	-23.04%
本基金	-19.03%

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

2011年市场呈现震荡下跌走势，上证综合指数下跌21.68%，沪深300指数下跌25.01%，中小盘综指下跌34.08%，创业板综指下跌35.42%。全年市场处于通胀攀升、企业利润增速下降，以及流动性偏紧的环境中，大部分个股出现了盈利和估值的双杀，全年业绩稳定增长的食品饮料和低估值的金融服务（尤其是银行）表现较好，而有色、电子、机械设备跌幅居前。2011年，欧债危机扩散、欧美经济低迷，出口方面受到较大影响，而作为经济主要拉动力的投资，由于房地产行业的调控以及动车事件后对相关投资的暂停，中期增速呈下降趋势。流动性方面，银行信贷投放量受到抑制，银行理财产品分流投资资金，与此同时市场上大量新股上市，发行定价不合理，二级市场大小非减持意愿强烈，流动性的紧张和股票供给增加使得市场整体估值中枢不断下移。

2011年本基金投资策略是以防御为主，通过仓位控制规避系统性风险，通过选择业绩稳定增长的行业和个股获取超额收益。本基金一季度消费类个股比重偏多，在铁路设备配置上出现失误，但在金融股的配置上取得一定正贡献；二季度增配了消费品，并采取了仓位控制策略；三季度以水泥股为代表的强周期对组合负贡献较大，本基金及时进行了减持；四季度对金融、大消费的配置使得组合的波动性减小、风险控制较好，获取了相对市场的超额收益。

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-19.03%，业绩比较基准收益率为-18.35%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2012年宏观经济内外部皆有隐忧：外部面临欧美经济不振，出口增速下降，此外出于资金避险和应急需求，海外资金可能回流，会对流动性造成冲击；内部面临的主要问题是经济增长缺乏新的推动力，过去十几年中国经济经历了出口导向和投资驱动模式，现在这种高耗能、高污染、需大量资金和人力投入的经济增长方式进入到瓶颈期，而新的经济增长点形成尚需要时间。

制度方面，去年11月份证监会颁布了强制分红制度、创业板退市制度、表达了对内幕交易零容忍态度，今年要继续完善新股发行制度、退市和分红制度，加强股市监管，预计高估值、概念性的板块估值会继续下移，而真正具备成长性且估值合理的公司会脱颖而出。

2012年本基金在行业和个股选择方面，会重点关注低估值、业绩有支撑的板块，以及业绩能保持稳定增长的公司。

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

1、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。

2、截至2011年12月31日，本基金每基金份额可供分配利润为-0.0246元，依据基金合同的约定，不进行利润分配。

§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

2011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

2011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对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为58，095，807.46元。

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2011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2011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（2012）第20586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：2011年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
资 产：		
银行存款	212，061，934.61	368，610，174.68
结算备付金	2，733，366.90	10，337，353.31
存出保证金	2，084，495.16	1，762，241.93
交易性金融资产	1，580，741，570.23	2，024，243，984.50
其中：股票投资	1，189，486，570.23	1，494，292，984.50
基金投资	-	-
债券投资	391，255，000.00	529，951，000.00
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	-	-
应收利息	7，703，496.60	16，118，608.55
应收股利	-	-
应收申购款	133，935.24	312，826.48
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1，805，458，798.74	2，421，385，189.45
负债和所有者权益	本期末 2011年12月31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	54，108，674.42	8，813，573.75
应付赎回款	829，030.11	1，556，064.49
应付管理人报酬	2，274，305.15	3，163，898.73
应付托管费	379，050.86	527，316.45
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1，967，829.26	5，414，134.30
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	1，095，022.74	1，106，513.76
负债合计	61，903，112.54	21，830，701.48
所有者权益：		
实收基金	1，787，498，676.87	1，942，408，387.34
未分配利润	-43，942，990.67	457，146，100.63
所有者权益合计	1，743，555，686.20	2，399，554，487.97
负债和所有者权益总计	1，805，458，798.74	2，421，385，189.45

注：报告截止日2011年12月31日，基金份额净值0.975元，基金份额总额1，787，498，676.87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：2011年1月1日 至 2011年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
一、收入	-372，309，925.02	-94，050，056.39
1.利息收入	19，562，303.77	25，049，205.64
其中：存款利息收入	1，794，383.72	1，813，506.19
债券利息收入	16，404，541.24	22，830，225.42
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1，363，378.81	405，474.03
其他利息收入	-	-
2.投资收益	-363，605，582.12	322，376，249.56
其中：股票投资收益	-370，564，989.22	315，271，797.44
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-6，611，008.97	-2，671，126.58
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	13，570，416.07	9，775，578.70
3.公允价值变动收益	-28，290，180.87	-441，599，156.37
4.汇兑收益	-	-
5.其他收入	23，534.20	123，644.78
减：二、费用	53，232，236.96	70，971，056.18
1.管理人报酬	30，457，311.08	40，689，645.49
2.托管费	5，076，218.55	6，781，607.55
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	17，480，520.89	23，275，300.14
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	218，186.44	224，503.00
三、利润总额	-425，542，161.98	-165，021，112.57
减：所得税费用	-	-
四、净利润	-425，542，161.98	-165，021，112.57

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：2011年1月1日 至 2011年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011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）	1，942，408，387.34	457，146，100.63	2，399，554，487.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-425，542，161.98	-425，542，161.98
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-154，909，710.47	-17，451，121.86	-172，360，832.33
其中：1.基金申购款	87，352，098.91	11，116，147.60	98，468，246.51
2.基金赎回款	-242，261，809.38	-28，567，269.46	-270，829，078.84
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-58，095，807.46	-58，095，807.46
五、期末所有者权益（基金净值）	1，787，498，676.87	-43，942，990.67	1，743，555，686.20
项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年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

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：颜锡廉　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 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	1，150，973，353.81	10.05	2，868，802，350.50	18.99

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 2011年1月1日至2011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	935，171.58	9.78	302，253.70	15.37
关联方名称	上年度可比期间 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

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 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	30，457，311.08	40，689，645.49
其中：支付销售机构的客户维护费	3，701，520.00	4，962，981.50

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 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5，076，218.55	6，781，607.55

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。

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

本报告期及上年度可比期间本基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

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，基金管理人主要股东及其控制的机构均未持有本基金份额。

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 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	212，061，934.61	1，710，701.96	368，610，174.68	1，736，651.12

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）在承销期承销的证券。

7.4.4.7 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。

7.4.5 期末（2011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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金本报告期末未持有因从事银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因从事交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

§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	1，189，486，570.23	65.88
	其中：股票	1，189，486，570.23	65.88
2	固定收益投资	391，255，000.00	21.67
	其中：债券	391，255，000.00	21.67
	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	214，795，301.51	11.90
6	其他各项资产	9，921，927.00	0.55
7	合计	1，805，458，798.74	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	8，464，000.00	0.49
C	制造业	544，682，192.28	31.24
C0	食品、饮料	188，242，999.80	10.80
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	38，578，975.86	2.21
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	15，648，481.95	0.90
C7	机械、设备、仪表	27，055，000.00	1.55
C8	医药、生物制品	275，156，734.67	15.78
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	10，699，994.65	0.61
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	55，949，970.16	3.21
G	信息技术业	43，251，930.98	2.48
H	批发和零售贸易	17，650，000.00	1.01
I	金融、保险业	308，881，386.21	17.72
J	房地产业	135，617，681.43	7.78
K	社会服务业	64，289，414.52	3.69
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1，189，486，570.23	68.22

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	000423	东阿阿胶	2，199，910	94，486，134.50	5.42
2	600519	贵州茅台	444，806	85，980，999.80	4.93
3	600887	伊利股份	3，400，000	69，462，000.00	3.98
4	601009	南京银行	7，399，756	68，669，735.68	3.94
5	600015	华夏银行	5，999，870	67，378，540.10	3.86
6	600085	同仁堂	4，499，939	63，134，144.17	3.62
7	000538	云南白药	1，065，000	56，445，000.00	3.24
8	600016	民生银行	9，499，940	55，954，646.60	3.21
9	601006	大秦铁路	7，499，996	55，949，970.16	3.21
10	600750	江中药业	1，692，464	49，081，456.00	2.82

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	600016	民生银行	191，254，831.43	7.97
2	600585	海螺水泥	186，753，324.31	7.78
3	600030	中信证券	175，735，704.66	7.32
4	601601	中国太保	166，297，511.59	6.93
5	601006	大秦铁路	156，677，200.00	6.53
6	000401	冀东水泥	129，402，640.80	5.39
7	601288	农业银行	124，589，989.08	5.19
8	600036	招商银行	121，434，167.92	5.06
9	600425	青松建化	105，936，452.50	4.41
10	600395	盘江股份	105，494，989.25	4.40
11	600309	烟台万华	101，142，509.64	4.22
12	000423	东阿阿胶	99，693，748.49	4.15
13	000039	中集集团	99，042，339.92	4.13
14	000858	五 粮 液	96，475，830.37	4.02
15	601988	中国银行	88，353，046.99	3.68
16	600383	金地集团	85，648，235.82	3.57
17	000680	山推股份	85，116，055.51	3.55
18	000338	潍柴动力	83，245，456.57	3.47
19	000877	天山股份	80，073，559.59	3.34
20	600015	华夏银行	74，434，263.18	3.10
21	000001	深发展A	73，351，108.70	3.06
22	002001	新 和 成	73，293，536.12	3.05
23	000002	万 科A	72，242，117.29	3.01
24	601998	中信银行	71，771，664.32	2.99
25	600085	同仁堂	71，093，519.41	2.96
26	000983	西山煤电	69，567，973.79	2.90
27	601009	南京银行	67，915，008.42	2.83
28	601888	中国国旅	66，333，178.43	2.76
29	600519	贵州茅台	65，531，652.90	2.73
30	600125	铁龙物流	63，750，957.98	2.66
31	600595	中孚实业	63，208，557.79	2.63
32	000157	中联重科	61，174，978.90	2.55
33	601166	兴业银行	53，671，983.98	2.24
34	000776	广发证券	53，449，981.24	2.23
35	000651	格力电器	52，898，776.97	2.20
36	000951	中国重汽	52，569，478.65	2.19
37	000402	金 融 街	52，467，708.96	2.19
38	002344	海宁皮城	51，590，346.85	2.15

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	600585	海螺水泥	174，172，940.98	7.26
2	600030	中信证券	160，935，867.02	6.71
3	000039	中集集团	150，067，493.98	6.25
4	600016	民生银行	139，183，121.13	5.80
5	601288	农业银行	124，790，786.57	5.20
6	000401	冀东水泥	113，541，926.51	4.73
7	000009	中国宝安	112，651，011.79	4.69
8	601166	兴业银行	111，959，617.39	4.67
9	601601	中国太保	110，584，810.20	4.61
10	000651	格力电器