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

2012 半年度 报告摘要

2012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：2012年8月29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”）2012年半年度报告摘要。

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基金合同》规定，于2012年8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。

本报告期自2012年1月1日起至6月30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	1,733,403,592.91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

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2012年1月1日－2012年6月30日）
本期已实现收益	-25,860,522.34
本期利润	40,145,038.30
加权平均基金份额本期利润	0.0227
本期基金份额净值增长率	2.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2012年6月30日）
期末可供分配基金份额利润	-0.0022
期末基金资产净值	1,729,664,365.95
期末基金份额净值	0.998

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）。

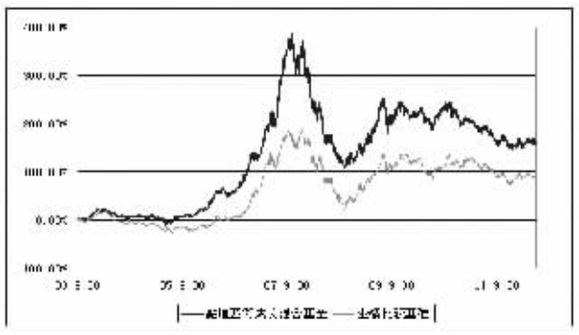
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	-1.96%	0.91%	-4.79%	0.82%	2.83%	0.09%
过去三个月	3.74%	0.87%	0.77%	0.84%	2.97%	0.03%
过去六个月	2.36%	0.96%	4.62%	1.00%	-2.26%	-0.04%
过去一年	-9.85%	0.90%	-13.25%	1.01%	3.40%	-0.11%
过去三年	-17.14%	1.09%	-11.27%	1.16%	-5.87%	-0.07%
自基金合同生效起至今	160.59%	1.26%	84.38%	1.40%	76.21%	-0.14%

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



§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2012年6月30日，公司管理的基金共有十四只：一只封闭式基金，即融通通乾封闭基金；十三只开放式基金，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、融通深证成份指数基金、融通四季添利债券基金和融通创业板指数基金。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		
严非	本基金的基金经理、融通行业景气混合基金基金经理	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。

注：任职日期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投资组合的原则，并制定了相应的制度和流程，在授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。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 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

上半年A股市场一波三折，呈现M型走势，年初市场预期政策放松，周期股有一定表现，但贷款投放量未达预期，三月市场下跌调整，四月份市场从低点走出一波反弹，进入五月，希腊问题加剧，加之国内政策力度和效果不如预期，市场一路下行。上半年上证综合指数上涨1.18%，沪深300指数上涨4.94%，深证综合指数上涨6.32%，上半年行业涨幅居前的是非银行金融、房地产、有色金属、食品饮料、综合、医药、建筑、电子元器件，但通信、电力设备、煤炭、计算机跌幅较多。从上半年市场表现看，指数虽然只是小幅上涨，但高成长性的个股表现远超市场，呈现出强者恒强的态势；利率敏感性资产，如房地产在政策放松的预期下有较好表现；非银行金融则在金融改革政策的刺激下表现抢眼；而与投资相关的周期股由于业绩低于预期，表现较差。

上半年本基金重点配置的是大金融板块和业绩稳定成长的公司。

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2.36%，业绩比较基准收益率为4.62%。

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年下半年宏观经济状况仍然较复杂：海外方面，欧洲经济危机虽有缓解但远未结束，若形势进一步恶化，全球经济下行风险加大；与此同时，美国经济的复苏程度、美元走势会对全球资金流向和大宗商品价格走势产生重大影响。国内方面，从上半年发放的信贷结构上可以看出，中长期贷款比重一直处于偏低水平，表明实际投资需求尤其是民间投资需求不足，经济增长动力缺乏。虽然央行在6、7月份连续两次降息，对降低资金成本、促进企业投资和个人消费需求有一定刺激作用，但经济潜在增长率下滑，结构转型任重道远，大部分行业和公司的赢利增速逐步下行。

从中期看，大部分周期性行业产能过剩问题将一直存在，若经济自然见底后未有效复苏，周期性行业业绩可能持续低于预期。在经济增速下行的过程中，真正具有良好成长性的公司弥足珍贵。即使是同一行业，公司之间的赢利也出现了较大的分化，加之大小非解禁，市场与产业资本的博弈仍在继续，对选股的要求不断提高。

下半年，本基金的重点选择仍在业绩具有持续性的行业和个股上。

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

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关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

2012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

2012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 托管人对本半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2012年上半年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 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：2012年6月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
资 产：		
银行存款	108,605,550.06	212,061,934.61
结算备付金	1,838,932.16	2,733,366.90
存出保证金	1,623,605.83	2,084,495.16
交易性金融资产	1,659,635,570.80	1,580,741,570.23
其中：股票投资	1,284,356,570.80	1,189,486,570.23
基金投资	-	-
债券投资	375,279,000.00	391,255,000.00
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	5,617,760.05	-
应收利息	7,703,557.28	7,703,496.60
应收股利	-	-
应收申购款	94,126.60	133,935.24
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,785,119,102.78	1,805,458,798.74
负债和所有者权益	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011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	48,227,585.41	54,108,674.42
应付赎回款	1,031,068.88	829,030.11
应付管理人报酬	2,143,159.17	2,274,305.15
应付托管费	357,193.18	379,050.86
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,575,883.04	1,967,829.26
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	870,647.15	1,095,022.74
负债合计	55,454,736.83	61,903,112.54
所有者权益：		
实收基金	1,733,403,592.91	1,787,498,676.87
未分配利润	-3,739,226.96	-43,942,990.67
所有者权益合计	1,729,664,365.95	1,743,555,686.20
负债和所有者权益总计	1,785,119,102.78	1,805,458,798.74

注：报告截止日2012年6月30日，基金份额净值0.998元，基金份额总额1,733,403,592.91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：2012年1月1日 至 2012年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
一、收入	61,675,292.25	-157,906,329.76
1.利息收入	6,845,375.77	11,789,765.86
其中：存款利息收入	433,317.09	996,725.94
债券利息收入	6,368,124.71	9,438,828.72
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	43,933.97	1,354,211.20
其他利息收入	-	-
2.投资收益	-11,231,575.66	-125,637,781.11
其中：股票投资收益	-22,304,322.37	-126,203,225.91
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-50,250.00	-6,917,408.97
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	11,122,996.71	7,482,853.77
3.公允价值变动收益	66,005,560.64	-44,074,202.01
4.汇兑收益	-	-
5.其他收入	55,931.50	15,887.50
减：二、费用	21,530,253.95	28,980,804.70
1.管理人报酬	13,046,533.14	16,228,478.54
2.托管费	2,174,422.12	2,704,746.45
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	6,187,264.79	9,930,371.63
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	122,033.90	117,208.08
三、利润总额	40,145,038.30	-186,887,134.46
减：所得税费用	-	-
四、净利润	40,145,038.30	-186,887,134.46

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：2012年1月1日 至 2012年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30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）	1,787,498,676.87	-43,942,990.67	1,743,555,686.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	40,145,038.30	40,145,038.30
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-54,095,083.96	58,725.41	-54,036,358.55
其中：1.基金申购款	20,564,552.56	-301,168.96	20,263,383.60
2.基金赎回款	-74,659,636.52	359,894.37	-74,299,742.15
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）	1,733,403,592.91	-3,739,226.96	1,729,664,365.95
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30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）	-	-186,887,134.46	-186,887,134.46
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-96,420,183.56	-14,355,758.54	-110,775,942.10
其中：1.基金申购款	60,461,128.73	9,996,507.19	70,457,635.92
2.基金赎回款	-156,881,312.29	-24,352,265.73	-181,233,578.02
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）	1,845,988,203.78	197,807,400.17	2,043,795,603.95

本报告6.1至6.4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

6.4 报表附注

6.4.1 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

本基金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一致。

6.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30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	1,040,838,159.13	25.53%	254,054,287.06	3.95%

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行其他类别交易。

6.4.4.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30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	851,452.29	24.89%	437,738.14	27.79%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30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	206,420.13	3.83%	153,387.91	8.44%

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。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	13,046,533.14	16,228,478.54
其中：支付销售机构的客户维护费	1,589,924.39	1,972,446.92

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。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,174,422.12	2,704,746.45

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。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 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基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.4.4.2 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。

6.4.4.5 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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30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	108,605,550.06	401,151.40	252,150,208.02	952,053.21

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。

6.4.4.6 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）在承销期承销的证券。

6.4.4.7 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。

6.4.5 期末（2012年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 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/增发而流通受限的证券。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 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。

6.4.5.3.2 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。

§7 投资组合报告

7.1 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	1,284,356,570.80	71.95
	其中：股票	1,284,356,570.80	71.95
2	固定收益投资	375,279,000.00	21.02
	其中：债券	375,279,000.00	21.02
	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	110,444,482.22	6.19
6	其他各项资产	15,039,049.76	0.84
7	合计	1,785,119,102.78	100.00

7.2 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	36,493,138.47	2.11
C	制造业	510,452,518.84	29.51
C0	食品、饮料	160,043,757.30	9.25
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	54,889,736.90	3.17
C5	电子	91,060,830.20	5.26
C6	金属、非金属	24,078,570.96	1.39
C7	机械、设备、仪表	107,987,298.68	6.24
C8	医药、生物制品	72,392,324.80	4.19
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	15,906,000.00	0.92
H	批发和零售贸易	36,496,500.00	2.11
I	金融、保险业	470,180,675.69	27.18
J	房地产业	149,790,839.62	8.66
K	社会服务业	54,688,363.82	3.16
L	传播与文化产业	10,348,534.36	0.60
M	综合类	-	-
	合计	1,284,356,570.80	74.25

7.3 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	601318	中国平安	1,925,000	88,049,500.00	5.09
2	000002	万 科A	8,499,982	75,734,839.62	4.38
3	600030	中信证券	5,499,902	69,463,762.26	4.02
4	601166	兴业银行	4,999,890	64,898,572.20	3.75
5	601336	新华保险	1,600,000	54,784,000.00	3.17
6	600048	保利地产	4,800,000	54,432,000.00	3.15
7	600104	上汽集团	3,499,872	50,013,170.88	2.89
8	600016	民生银行	8,000,000	47,920,000.00	2.77
9	600138	中青旅	2,099,909	37,756,363.82	2.18
10	600315	上海家化	949,850	37,053,648.50	2.14

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）的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600166	福田汽车	91,195,510.30	5.23
2	600030	中信证券	87,936,334.02	5.04
3	601318	中国平安	79,776,389.98	4.58
4	600016	民生银行	75,092,403.25	4.31
5	601166	兴业银行	68,488,644.22	3.93
6	600036	招商银行	67,844,732.85	3.89
7	002024	苏宁电器	67,426,352.92	3.87
8	000651	格力电器	59,825,366.74	3.43
9	000002	万 科A	58,651,825.49	3.36
10	601628	中国人寿	56,768,537.41	3.26
11	600060	海信电器	53,302,255.39	3.06
12	600104	上汽集团	52,310,652.01	3.00
13	601006	大秦铁路	48,465,900.00	2.78
14	601336	新华保险	46,346,870.50	2.66
15	002241	歌尔声学	40,042,877.88	2.30
16	000776	广发证券	39,115,251.21	2.24
17	000401	冀东水泥	38,757,162.42	2.22
18	000009	中国宝安	36,851,219.68	2.11
19	600498	烽火通信	36,422,573.75	2.09
20	000338	潍柴动力	36,312,890.54	2.08
21	600138	中青旅	36,258,575.02	2.08
22	600837	海通证券	35,912,350.13	2.06
23	300146	汤臣倍健	35,101,288.07	2.01

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。

7.4.2 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	601006	大秦铁路	106,119,846.21	6.09
2	600166	福田汽车	100,597,846.44	5.77
3	000423	东阿阿胶	87,941,306.84	5.04
4	600016	民生银行	85,167,467.16	4.88
5	600519	贵州茅台	72,781,332.97	4.17
6	601009	南京银行	71,031,203.06	4.07
7	600015	华夏银行	66,740,919.44	3.83
8	600036	招商银行	64,105,056.58	3.68
9	600887	伊利股份	61,865,952.59	3.55
10	600837	海通证券	59,955,719.43	3.44
11	600585	海螺水泥	48,717,553.10	2.79
12	600085	同仁堂	47,933,713.76	2.75
13	000069	华侨城A	47,644,542.59	2.73
14	601601	中国太保	47,088,935.01	2.70
15	600750	江中药业	44,259,963.12	2.54
16	601699	潞安环能	42,358,533.55	2.43
17	600060	海信电器	39,221,977.37	2.25
18	000002	万 科A	38,571,872.54	2.21
19	000776	广发证券	38,062,729.57	2.18
20	000538	云南白药	35,825,976.38	2.05
21	601336	新华保险	35,355,198.46	2.03

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。

7.4.3 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	2,064,259,066.58
卖出股票收入（成交）总额	2,011,266,724.28

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。

7.5 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	295,225,000.00	17.07
3	金融债券	80,054,000.00	4.63
	其中：政策性金融债	80,054,000.00	4.63
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	375,279,000.00	21.70

7.6 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	1101098	11央行票据98	1,000,000	96,990,000.00	5.61
2	1101088	11央行票据88	1,000,000	96,910,000.00	5.60
3	1101081	11央行票据81	500,000	51,300,000.00	2.97
4	1001037	10央行票据37	500,000	50,025,000.00	2.89
5	090412	09农发12	500,000	50,000,000.00	2.89

7.7 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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本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。

7.9.2 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

7.9.3 期末其他各项资