融通通利系列证券投资基金之

融通深证100指数证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3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
报告送出日期：2014年4月19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。本报告为融通通利系列证券投资基金之子基金融通深证100指数证券投资基金（以下简称“本基金”）2014年第1季度报告。

基金管理人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2014年4月16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基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至2014年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通深证100指数
交易代码	161604
前端交易代码	161604
后端交易代码	161654
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
报告期末基金份额总额	13,354,033,030.10份
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
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2014年1月1日 - 2014年3月31日 ）
1.本期已实现收益	-22,431,255.66
2.本期利润	-1,186,121,549.75
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0876
4.期末基金资产净值	11,035,419,624.73
5.期末基金份额净值	0.826

注：1、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；

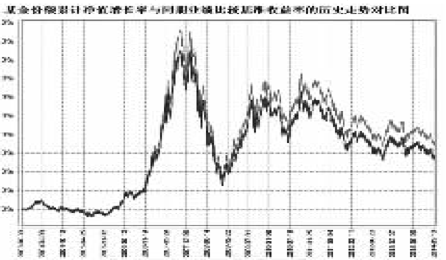
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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
过去三个月	-9.63%	1.29%	-9.49%	1.29%	-0.14%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注：本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“深证100指数×75%+银行间债券综合指数×25%”，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%”。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）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		
王建强	本基金的基金经理、融通巨潮100指数基金（LOF）基金经理、融通深证成份指数基金基金经理、融通创业板指数基金基金经理	2009年5月15日	-	10	本科学历，具有证券从业资格。2001年至2004年就职于上海市万得信息技术股份有限公司；2004年至今就职于融通基金管理有限公司，历任金融工程研究员、基金经理助理职务。

注：任职日期指根据基金管理人对外披露的任职日期填写；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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

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。本基金运用指数化投资方式，竭力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。

2014年1季度证券市场风格分化明显，大盘指数中沪深300指数下跌7.88%，创业板指数上涨1.79%。从中信行业类指数的表现来看：计算机行业涨幅7.29%，餐饮旅游涨幅6.76%、轻工制造行业涨幅4.44%、电力设备行业涨幅3.67%、通信行业涨幅2.75%；而煤炭、非银金融、农林牧渔行业指数跌幅均超过10%，落后于沪深300指数。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为-9.63%，同期业绩比较基准收益率为-9.49%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	10,421,989,582.82	94.20
	其中：股票	10,421,989,582.82	94.20
2	固定收益投资	499,940,000.00	4.52
	其中：债券	499,940,000.00	4.52
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	77,451,664.80	0.70
7	其他资产	63,796,749.67	0.58
8	合计	11,063,177,997.29	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	60,798,272.60	0.55
B	采矿业	274,510,575.23	2.49
C	制造业	6,189,085,829.18	56.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	102,223,796.26	0.93
E	建筑业	148,091,634.84	1.34
F	批发和零售业	243,494,463.42	2.21
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	448,976,480.19	4.07
J	金融业	1,118,925,577.16	10.14
K	房地产业	992,646,473.50	9.00
L	租赁和商务服务业	112,268,610.74	1.02
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	338,648,408.60	3.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	296,127,900.74	2.68
S	综合	96,191,560.36	0.87
	合计	10,421,989,582.82	94.44

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000002	万 科A	74,504,134	602,738,444.06	5.46
2	000651	格力电器	19,509,356	546,261,968.00	4.95
3	000001	平安银行	35,249,728	379,639,570.56	3.44
4	000333	美的集团	6,238,181	281,217,199.48	2.55
5	000858	五 粮 液	15,081,784	251,413,339.28	2.28
6	000776	广发证券	24,839,486	245,414,121.68	2.22
7	002024	苏宁云商	34,685,821	243,494,463.42	2.21
8	000895	双汇发展	5,255,134	206,474,214.86	1.87
9	002415	海康威视	11,196,901	195,385,922.45	1.77
10	000063	中兴通讯	15,343,928	193,947,249.92	1.76

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	499,940,000.00	4.53
	其中：政策性金融债	499,940,000.00	4.53
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	499,940,000.00	4.53

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	130218	13国开18	4,600,000	460,000,000.00	4.17
2	130227	13国开27	400,000	39,940,000.00	0.36

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细?

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	852,101.76
2	应收证券清算款	43,135,553.00
3	应收股利	-
4	应收利息	15,213,739.32
5	应收申购款	4,595,355.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	63,796,749.67

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资部分前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	13,700,692,357.66
报告期期间基金总申购份额	406,773,731.81
减:报告期期间基金总赎回份额	753,433,059.37
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	13,354,033,030.10

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

（一）中国证监会批准融通通利系列证券投资基金设立的文件

（二）《融通通利系列证券投资基金基金合同》

（三）《融通通利系列证券投资基金托管协议》

（四）《融通通利系列证券投资基金招募说明书》及其更新

（五）融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照

（六）报告期内在指定报刊上披露的各项公告

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件，或登陆本基金管理人网站www.rtfund.com查询。

融通基金管理有限公司
二〇一四年四月十九日

融通蓝筹成长证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3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
报告送出日期：2014年4月19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”）2014年第1季度报告。

基金管理人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2014年4月16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基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至2014年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通蓝筹成长混合
交易代码	161605
前端交易代码	161605
后端交易代码	161655
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
报告期末基金份额总额	1,452,062,318.85份
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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2014年1月1日 - 2014年3月31日 ）
1.本期已实现收益	21,421,765.53
2.本期利润	-42,736,761.43
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0291
4.期末基金资产净值	1,436,171,589.89
5.期末基金份额净值	0.989

注：1、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；

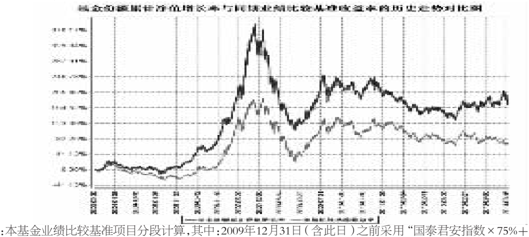
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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
过去三个月	-2.98%	1.42%	-5.57%	0.90%	2.59%	0.52%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



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%”。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）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、融通行业景气混合基金基金经理	2007年3月2日	-	11	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职日期填写；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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年1季度A股市场各类指数表现分化，上证指数下跌3.91%，深证成指下跌11.48%，中小板指数下跌7.73%，创业板指数上涨1.79%。板块来看，计算机、休闲服务、电气设备、新能源汽车、轻工制造等行业表现较好。本基金投资策略是行业景气度提升的行业和个股，重点布局了高端装备、医疗服务和计算机板块等行业，在本季度前半段时间获取了一定的超额收益，但由于三月份本基金减仓不及时，使得净值出现了较多的损失。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为-2.98%，同期业绩比较基准收益率为-5.57%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,048,935,929.70	72.63
	其中：股票	1,048,935,929.70	72.63
2	固定收益投资	329,045,960.00	22.78
	其中：债券	329,045,960.00	22.78
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	55,697,653.45	3.86
7	其他资产	10,536,487.36	0.73
8	合计	1,444,216,030.51	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	29,920,000.00	2.08
B	采矿业	40,074,937.50	2.79
C	制造业	640,305,592.54	44.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	7,170,000.00	0.50
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	266,304,462.70	18.54
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	28,760,036.96	2.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	36,400,900.00	2.53
S	综合	-	-
	合计	1,048,935,929.70	73.04

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002219	恒康医疗	2,407,867	59,329,842.88	4.13
2	300307	慈星股份	4,829,643	55,589,190.93	3.87
3	600570	恒生电子	2,699,530	54,260,553.00	3.78
4	600587	新华医疗	542,816	45,346,848.64	3.16
5	002565	上海绿新	2,229,366	45,256,129.80	3.15
6	300048	合康变频	5,000,000	42,400,000.00	2.95
7	300024	机器人	879,848	40,209,053.60	2.80
8	300164	通源石油	1,954,875	40,074,937.50	2.79
9	300045	华力创通	1,964,860	38,550,553.20	2.68
10	002474	榕基软件	2,799,927	37,827,013.77	2.63

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	327,933,000.00	22.83
	其中：政策性金融债	327,933,000.00	22.83
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,112,960.00	0.08
8	其他	-	-
9	合计	329,045,960.00	22.91

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	130227	13国开27	1,000,000	99,850,000.00	6.95
2	100236	10国开36	500,000	49,975,000.00	3.48
3	120229	12国开29	500,000	49,060,000.00	3.42
4	120219	12国开19	300,000	29,712,000.00	2.07
5	120215	12国开15	300,000	29,703,000.00	2.07

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细?

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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、处罚的情形：

1、本基金持有的通源石油在2013年11月21日公告被陕西省证监局立案调查，并于2013年12月10日公告收到陕西证监局《关于对西安通源石油科技股份有限公司采取责令改正措施的决定》的公告，公告里查明通源石油违反了《证券法》第六十三条、《上市公司信息披露管理办法》（证监会令第40号）第二条的规定，应当在2013年12月25日前，向陕西证监局提交书面报告，详细说明整改落实情况。本基金是在2014年投资通源石油，是在公司信息披露已经整改合规后才进行投资的。

2、报告期内，基金投资的前十名证券中其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,926,290.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,106,931.81
5	应收申购款	503,265.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,536,487.36

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	110022	同仁转债	1,112,960.00	0.08

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600570	恒生电子	54,260,553.00	3.78	重大事项
2	600587	新华医疗	45,346,848.64	3.16	资产重组

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,456,626,891.70
报告期期间基金总申购份额	74,973,421.86
减:报告期期间基金总赎回份额	79,537,994.71
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,452,062,318.85

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

（一）中国证监会批准融通通利系列证券投资基金设立的文件

（二）《融通通利系列证券投资基金基金合同》

（三）《融通通利系列证券投资基金托管协议》

（四）《融通通利系列证券投资基金招募说明书》及其更新

（五）融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照

（六）报告期内在指定报刊上披露的各项公告

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件，或登陆本基金管理人网站www.rtfund.com查询。

融通基金管理有限公司
二〇一四年四月十九日

融通新蓝筹证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31日

基金管理人：融通基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：2014年4月19日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年4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基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通新蓝筹混合
交易代码	161601
前端交易代码	161601
后端交易代码	161602
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年9月13日
报告期末基金份额总额	12,377,965,824.64份
投资目标	主要投资于处于成长阶段和成熟阶段早期的 新蓝筹”上市公司。通过组合投资，在充分控制风险的前提下实现基金净值的稳定增长，为基金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。在正常市场状况下，股票投资比例浮动范围：30%-75%；债券投资比例浮动范围：20%-55%；权证投资比例浮动范围：0%-3%；现金留存比例浮动范围：不低于5%。
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	在适度风险下追求较高收益
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2014年1月1日-2014年3月31日）
1.本期已实现收益	53,287,241.96
2.本期利润	-572,474,060.95
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0453
4.期末基金资产净值	8,678,393,435.59
5.期末基金份额净值	0.7011

注：1、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；

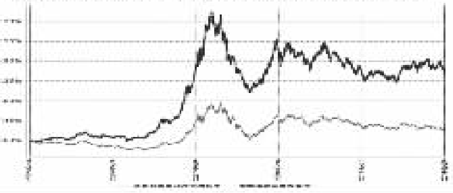
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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
过去三个月	-6.24%	1.11%	-5.57%	0.90%	-0.67%	0.21%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注：上图中基金业绩比较基准项目分段计算，其中2009年12月31日之前（含此日）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%”。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）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		
汪忠远	本基金的基金经理、融通通乾封闭基金的基金经理	2010年4月23日	-	18	毕业于曼彻斯特大学商学院，研究生学历，具有证券从业资格。1993年至1997年，任职君安证券武汉营业部投资经理；1997年至1999年，任职延宁发展有限公司证券投资部经理；2001年至2005年，任职深圳林奇投资顾问有限公司投资经理；2006年加入融通基金管理有限公司，历任机构理财部投资经理助理。
吴巍	本基金的基金经理、融通医疗保健行业股票基金、融通通祥一年目标触发式混合基金基金经理，基金管理部总监	2011年4月6日	-	21	硕士学位，21年证券从业经验，具有证券从业资格。自1993年7月起，先后任职珠海丽珠医药集团公司药品开发工程师、中旅信证券深圳研究所行业研究员、深圳市至善投资有限公司行业研究员、宝盈基金管理有限公司行业研究员，2003年12月进入融通基金管理有限公司，先后任行业研究员、研究部总监、基金管理部总监。
姚昆	本基金的基金经理	2012年7月25日	-	9	经济学硕士，具有证券从业资格。硕士毕业后即加入广发证券股份有限公司，任发展研究中心研究员，从事装备制造业上市公司研究工作。2007年加入融通基金管理有限公司，历任研究部行业研究员、行业组长、部门总监助理。

注：任职日期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、《融通新蓝筹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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年一季度A股市场各类指数表现分化，上证指数下跌3.91%，深证成指下跌11.48%，中小板指数下跌7.73%，创业板指数上涨1.79%。板块来看，计算机、休闲服务、电气设备、新能源汽车、轻工制造等行业表现较好。本基金投资策略是行业景气度提升的行业和个股，重点布局了高端装备、医疗服务和计算机板块等行业，在本季度前半段时间获取了一定的超额收益，但由于三月份本基金减仓不及时，使得净值出现了较多的损失。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为-6.24%，同期业绩比较基准收益率为-5.57%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	5,485,797,819.04	62.95
	其中：股票	5,485,797,819.04	62.95
2	固定收益投资	2,023,404,021.00	23.22
	其中：债券	2,023,404,021.00	23.22
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	130,100,585.05	1.49
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,008,162,619.01	11.57
7	其他资产	66,499,764.58	0.76
8	合计	8,713,964,808.68	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	34,144,369.50	0.39
C	制造业	3,949,565,470.15	45.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,491,523.89	0.29
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	94,263,898.11	1.09
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	775,322,162.81	8.93
J	金融业	-	-
K	房地产业	80,900,000.00	0.93
L	租赁和商务服务业	123,063,817.05	1.42
M	科学研究和技术服务业	29,647,020.72	0.34
N	水利、环境和公共设施管理业	64,965,341.77	0.75
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	308,434,215.04	3.55
S	综合	-	-
	合计	5,485,797,819.04	63.21

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600587	新华医疗	4,132,621	345,239,158.34	3.98
2	600633	浙报传媒	11,612,734	308,434,215.04	3.55
3	600196	复星医药	14,302,690	286,482,880.70	3.30
4	300104	乐视网	6,500,773	242,803,871.55	2.80
5	600535	天士力	6,116,649	238,488,144.51	2.75
6	002219	恒康医疗	6,000,000	147,840,000.00	1.70
7	300307	慈星股份	11,562,833	133,088,207.83	1.53
8	600887	伊利股份	3,500,874	125,436,315.42	1.45
9	300003	乐普医疗	6,009,902	123,082,792.96	1.42
10	002334	英威腾	8,501,622	122,423,356.80	1.41

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,992,555,000.00	22.96
	其中：政策性金融债	1,992,555,000.00	22.96
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	30,849,021.00	0.36
8	其他	-	-
9	合计	2,023,404,021.00	23.32

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	120219	12国开19	3,400,000	336,736,000.00	3.88
2	130238	13国开38	2,400,000	232,080,000.00	2.67
3	110234	11国开34	2,000,000	199,900,000.00	2.30
4	130218	13国开18	1,900,000	190,000,000.00	2.19
5	110257	11国开57	1,500,000	149,550,000.00	1.72

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,899,374.13
2	应收证券清算款	9,857,695.98
3	应收股利	-
4	应收利息	54,583,726.09
5	应收申购款	158,968.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	66,499,764.58

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	110023	民生转债	26,553,000.00	0.31

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600587	新华医疗	345,239,158.34	3.98	重大事项停牌
2	600633	浙报传媒	308,434,215.04	3.55	非公开发行
3	300003	乐普医疗	123,082,792.96	1.42	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	12,847,169,380.12
报告期期间基金总申购份额	10,699,153.26
减:报告期期间基金总赎回份额	479,902,708.74
报告期期末基金份额总额	12,377,965,824.64

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

（一）中国证监会批准融通新蓝筹证券投资基金设立的文件

（二）《融通新蓝筹证券投资基金基金合同》

（三）《融通新蓝筹证券投资基金托管协议》

（四）《融通新蓝筹证券投资基金招募说明书》及其更新

（五）融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照

（六）报告期内在指定报刊上披露的各项公告

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件，或登陆本基金管理人网站http://www.rtfund.com查询。

融通基金管理有限公司
二〇一四年四月十九日