融通领先成长股票型证券投资基金(LOF)

2014 第三季度 报告

2014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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月25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10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,投资者在做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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通领先成长股票(LOF)
交易代码	161610
前端交易代码	161610
后端交易代码	161660
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2007年4月30日
报告期末基金份额总额	2,695,107,180.34份
投资目标	本基金主要投资于业绩能持续高速增长的上市公司,通过积极主动的分散化投资策略,在严格控制风险的前提下实现基金资产的持续增长,为基金持有人获取长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金认为股价上升的主要推动力来自于企业盈利的不断增长。在中国经济长期高速增长的大背景下,许多企业在一定时期表现出较高的成长性,但只有符合产业结构发展趋势,同时在技术创新、经营模式、品牌、渠道、成本等方面具有领先优势的企业,才能保持业绩持续高速成长,而这些企业正是本基金重点投资的目标和获得长期超额回报的基础。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中信标普全债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金是较高预期收益较高预期风险的产品,其预期收益与风险高于混合基金、债券基金与货币市场基金。
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7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	85,100,925.97
2.本期利润	168,242,855.94
3.加权平均基金份额本期利润	0.0600
4.期末基金资产净值	2,049,565,307.66
5.期末基金份额净值	0.760

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。

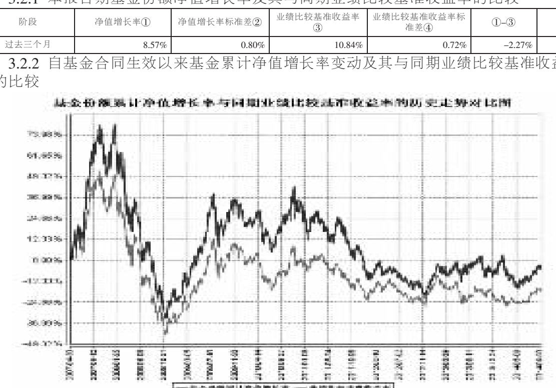
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	8.57%	0.80%	10.84%	0.72%	-2.27%	0.08%

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



§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		
余志勇	本基金的基金经理	2012年8月10日	-	14	金融学硕士,具有证券从业资格。先后任职于湖北省农业厅、闽发证券,2004年加入招商证券股份有限公司研究发展中心,从事房地产行业研究工作,2007年加入融通基金管理有限公司,曾任研究部行业研究员、行业组长。

注:任职日期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的工作时间为计算标准。

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、《融通领先成长股票型证券投资基金(LOF)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年三季度资本市场整体走势强劲:创业板上涨9.69%、中小板上涨16.9%、上证综指上涨15.4%、沪深300上涨13.20%。其中创业板和中小板在季度初有一波小幅回调,随后依然按照"主题+成长"的风格进行演绎;上证综指和沪深300出现明显的补涨行情,尤其是一些低市值的个股涨幅巨大。

本基金三季度业绩也呈现稳步提升态势:在维持配置相对均衡的基本策略下,依然坚守信息技术、高端装备、医药等板块中的优质成长股,适度增加了一些农业、化工等板块的个股,在季度中后期逐步减持了一些传统周期股的权重,但在对主题投资方面偏于保守,导致基金净值增长幅度一般。

4.5 报告期内基金的业绩表现

从本季度的投资结果来看,本基金净值增长率为8.57%,比较基准,业绩表现一般,主要的正贡献来自计算机、医药、高端装备等板块中部分个股的超额收益,主要的负贡献来自传媒、金融地产、家电、食品饮料等板块中的部分个股。

§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	1,783,340,414.80	86.27
	其中:股票	1,783,340,414.80	86.27
2	固定收益投资	80,179,000.00	3.88
	其中:债券	80,179,000.00	3.88
	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	129,200,513.80	6.25
	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	72,296,385.87	3.50
7	其他资产	2,218,924.01	0.11
8	合计	2,067,235,238.48	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	18,963,770.48	0.93
B	采矿业	54,426,077.96	2.66
C	制造业	1,191,414,671.22	58.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	42,972,212.92	2.10
E	建筑业	12,800,843.20	0.62
F	批发和零售业	44,466,109.24	2.17
G	交通运输、仓储和邮政业	20,389,776.88	0.99
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	151,545,142.56	7.39
J	金融业	114,985,558.24	5.61
K	房地产业	48,841,524.80	2.38
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	64,144,567.30	3.13
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	18,390,160.00	0.90
S	综合	-	-
	合计	1,783,340,414.80	87.01

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	002008	大族激光	3,670,782	71,763,788.10	3.50
2	600584	长电科技	5,349,931	63,878,176.14	3.12
3	002156	通富微电	6,582,597	61,415,630.01	3.00
4	600872	中炬高新	5,500,000	60,500,000.00	2.95
5	300145	南方泵业	2,721,441	57,068,617.77	2.78
6	002385	大北农	3,952,113	54,499,638.27	2.66
7	600594	益佰制药	1,452,836	54,481,350.00	2.66
8	002683	宏大爆破	1,707,217	54,426,077.96	2.66
9	601318	中国平安	1,088,350	44,992,389.00	2.20
10	300017	网宿科技	800,000	44,736,000.00	2.18

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	80,179,000.00	3.91
	其中:政策性金融债	80,179,000.00	3.91
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	80,179,000.00	3.91

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	140430	14农发30	500,000	50,110,000.00	2.44
2	140320	14进出20增	300,000	30,069,000.00	1.47

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	271,737.36
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,881,752.80
5	应收申购款	50,310.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	15,123.20
8	其他	-
9	合计	2,218,924.01

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,879,114,018.79
报告期期间基金总申购份额	2,341,215.28
减:报告期期间基金总赎回份额	186,348,053.73
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	2,695,107,180.34

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期期初基金份额总额	44,418,366.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	44,418,366.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.65

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内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《关于核准通宝证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》

(二)《融通领先成长股票型证券投资基金(LOF)基金合同》

(三)《融通领先成长股票型证券投资基金(LOF)托管协议》

(四)《融通领先成长股票型证券投资基金(LOF)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、深圳证券交易所。

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
二〇一四年十月二十五日

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

2014 第三季度 报告

2014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
报告送出日期:2014年10月25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3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10月21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7月1日起至2014年9月30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	1,321,408,503.78份
投资目标	组合投资,资本增值,为持有人谋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7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	103,410,894.37
2.本期利润	182,979,851.80
3.加权平均基金份额本期利润	0.1337
4.期末基金资产净值	1,504,988,169.58
5.期末基金份额净值	1.139

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	13.45%	0.67%	10.26%	0.67%	3.19%	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: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年三季度A股市场各类指数均有较好表现,上证指数上涨15.40%,深证成指上涨10.04%,中小板指数上涨16.90%,创业板指数上涨9.69%。板块来看,国防军工、汽车、纺织服装、机械、钢铁、农林牧渔、公用事业、休闲服务等行业大幅上涨。本基金投资策略是布局计算机、医疗服务、高端装备等高景气行业,布局国企改革方向的企业。三季度本基金持仓的计算机、医疗服务、机械、国企改革板块等均产生了较好的正贡献。

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13.45%,同期业绩比较基准收益率为10.26%。

§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	954,356,765.28	62.21
	其中:股票	954,356,765.28	62.21
2	固定收益投资	381,105,192.50	24.84
	其中:债券	381,105,192.50	24.84
	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	184,221,879.34	12.01
7	其他资产	14,517,908.53	0.95
8	合计	1,534,201,745.65	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	1,665,300.00	0.11
B	采矿业	106,000,000.00	7.04
C	制造业	504,199,047.57	33.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	47,550,685.31	3.16
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	44,148,266.10	2.93
G	交通运输、仓储和邮政业	15,213,000.00	1.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	138,324,281.36	9.19
J	金融业	24,010,000.00	1.60
K	房地产业	18,750,000.00	1.25
L	租赁和商务服务业	28,402,500.00	1.89
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	26,093,684.94	1.73
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	954,356,765.28	63.41

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	600028	中国石化	20,000,000	106,000,000.00	7.04
2	600570	恒生电子	1,609,960	67,908,112.80	4.51
3	300307	慈星股份	4,859,755	59,580,596.30	3.96
4	300045	华力创通	2,555,510	59,390,052.40	3.95
5	600594	益佰制药	1,574,925	59,059,687.50	3.92
6	600839	四川长虹	10,000,000	43,300,000.00	2.88
7	002153	石基信息	550,000	38,720,000.00	2.57
8	000852	江钻股份	1,299,929	33,954,145.48	2.26
9	600582	天地科技	3,000,000	33,600,000.00	2.23
10	600707	彩虹股份	2,999,901	31,768,951.59	2.11

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	379,947,000.00	25.25
	其中:政策性金融债	379,947,000.00	25.25
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,158,192.50	0.08
8	其他	-	-
9	合计	381,105,192.50	25.32

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	140204	14国开04	1,000,000	100,240,000.00	6.66
2	140207	14国开07	900,000	90,207,000.00	5.99
3	100236	10国开36	500,000	50,145,000.00	3.33
4	120229	12国开29	500,000	49,665,000.00	3.30
5	120219	12国开19	300,000	29,940,000.00	1.99

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	903,452.01
2	应收证券清算款	4,894,536.17
3	应收股利	-
4	应收利息	7,982,235.65
5	应收申购款	737,684.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,517,908.53

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	1,158,192.50	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	600839	四川长虹	43,300,000.00	2.88	重大事项披露

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,407,929,299.40
报告期期间基金总申购份额	15,233,384.42
减:报告期期间基金总赎回份额	101,754,180.04
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,321,408,503.78

§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
二〇一四年十月二十五日

融通新蓝筹证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月25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10月23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7月1日起至9月30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	11,243,924,700.34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资产的稳定增长,为基金持有人谋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7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	79,868,254.31
2.本期利润	366,224,558.08
3.加权平均基金份额本期利润	0.0315
4.期末基金资产净值	8,355,196,233.33
5.期末基金份额净值	0.7431

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。

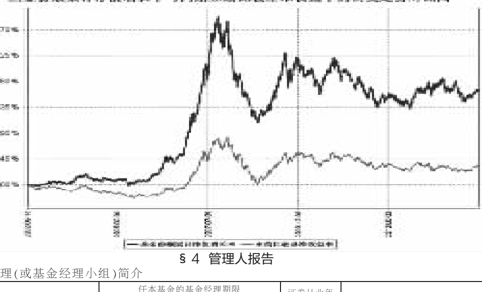
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	4.47%	0.56%	10.26%	0.67%	-5.79%	-0.11%

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



§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年三季度,随着稳经济政策逐渐出台和改革预期的加强,市场表现相对强势,沪深300指数上涨了13.20%,中小板指数上涨了16.90%,创业板指数受权重股表现的拖累只上涨了9.69%,大批小市值公司不断创出历史新高。

在前期稳经济的政策刺激下,经济企稳反弹,但内生增长动能依然有限;在目前的时间点上,政策进一步放松的预期在减弱,经济回落的幅度政策对冲的力度使得市场在未来一个季度会继续纠结;地产投资的下滑幅度,决定了本轮调整的深度,因此,尽管政府不断出台对冲政策,但金融地产和投资品依然缺乏中长期的逻辑,7月的蓝筹反弹使得市场再度活跃,但市场中的做多资金迅速抛弃了传统蓝筹资产,将小盘股的行情继续演绎。流动性方面,尽管信贷和社融总量大幅低于市场预期,但13%左右的M2增速能够保证市场的资金需求,再加之CPI稳定在2%左右,整体流动性局面相对仍处于比较宽松的水平,未来的实际利率逐渐下行是大概率事件。

在宏观环境相对平稳,改革政策逐步推进,实际利率有效回落的背景下,市场会保持一定的热度,届时在国企改革、沪港通、四中全会等热点的带动下,行情仍将继续演绎。然而,在目前的估值水平下,政策期盼和企业盈利预期的兑现与否存在一定的不确定性,但场外资金的不断进入,改变了原有的博弈格局,加剧了行情判断的难度,四季度的市场可能会出现一定程度的结构分化。从板块上看,三季度表现较好的行业为国防军工、农林牧渔、服装纺织、交通运输和机械等,跌幅靠前的行业为银行、家电、传媒、食品饮料和石油石化。国防军工连续两个季度跑赢市场,是今年市场中最具锐度的板块之一。

三季度以来,融通新蓝筹基金在对经济和市场分析的基础上,对组合进行了一定程度的调整。增加了部分环保和国企改革受益的相关资产,同时减持了部分医药股,使得组合的结构更有锐度。消费成长仍然是我们长期看好的方向性资产,医药、TMT和环保是组合的核心。但在目前的市场环境中,估值的压力、IPO的启动和业绩的逐渐披露,使得成长股可能会出现一定程度的分化。

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4.47%,同期业绩比较基准收益率为10.26%。

§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	5,768,494,558.69	68.72
	其中:股票	5,768,494,558.69	68.72
2	固定收益投资	2,010,829,697.00	23.95
	其中:债券	2,010,829,697.00	23.95
	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	4,116,122.06	0.05
	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	568,793,366.41	6.78
7	其他资产	42,326,940.96	0.50
8	合计	8,394,560,685.12	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	36,701,115.68	0.44
B	采矿业	68,145,000.00	0.82
C	制造业	3,007,178,502.20	35.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	419,940,558.99	5.03
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	100,557,117.28	1.20
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	691,258,541.69	8.27
J	金融业	514,839,009.72	6.16
K	房地产业	285,330,075.69	3.42
L	租赁和商务服务业	120,498,409.40	1.44
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	293,820,486.28	3.52
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	230,225,741.76	2.76
S	综合	-	-
	合计	5,768,494,558.69	69.04

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	601318	中国平安	7,999,949	330,717,891.66	3.96
2	600587	新华医疗	6,680,000	249,898,800.00	2.99
3	600196	复星医药	12,000,000	228,480,000.00	2.73
4	600535	天士力	5,200,842	216,251,010.36	2.59
5	600594	益佰制药	5,000,099	187,503,712.50	2.24
6	000002	万 科A	18,000,000	165,240,000.00	1.98
7	600008	首创股份	19,999,939	153,999,530.30	1.84
8	600446	金证股份	3,500,651	144,331,840.73	1.73
9	000651	格力电器	5,000,000	138,650,000.00	1.66
10	002219	恒康医疗	5,500,000	128,865,000.00	1.54

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	1,978,005,000.00	23.67
	其中:政策性金融债	1,978,005,000.00	23.67
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	32,824,697.00	0.39
8	其他	-	-
9	合计	2,010,829,697.00	24.07

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	140429	14农发29	2,500,000	250,575,000.00	3.00
2	120219	12国开19	2,100,000	209,580,000.00	2.51
3	140212	14国开12	1,700,000	170,187,000.00	2.04
4	140207	14国开07	1,500,000	150,345,000.00	1.80
5	110257	11国开57	1,500,000	150,045,000.00	1.80

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	1,276,511.34
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	40,786,042.45
5	应收申购款	264,387.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,326,940.96

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	28,068,000.00	0.34
2	113005	平安转债	4,756,697.00	0.06

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	11,985,981,243.22
报告期期间基金总申购份额	9,529,125.25
减:报告期期间基金总赎回份额	751,585,668.13
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	11,243,924,700.34

§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
二〇一四年十月二十五日