

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 第一季度 报告

2012年3月31日

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		

A	农林牧渔, 林业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	593,325,635.36	34.87
C0	食品、饮料	185,880,018.42	10.92
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	47,642,732.74	2.80
C5	电子	78,238,445.68	4.60

C6	金属、非金属	—	—
C7	机械、设备、仪表	154,549,438.52	9.08
C8	医药、生物制品	127,015,000.00	7.47
C99	其他制造业	—	—
D	电力、煤气及水的生产和供应业	10,199,994.90	0.60
E	建筑业	—	—
F	交通运输、仓储业	67,050,000.00	3.94
G	信息技术业	34,733,007.36	2.04
H	批发和零售业	63,374,493.00	3.72
I	金融、保险业	225,464,510.00	13.25
J	房地产业	160,212,605.68	9.42
K	社会服务业	32,512,700.94	1.91
L	传播与文化业	—	—
M	综合类	—	—
	合计	1,186,872,955.29	69.76

5.3 报告期末按公允价值计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	600887	伊利股份	3,999,902	88,157,840.08	5.18
2	000002	万科A	4,999,869	78,688,915.34	4.62
3	601006	大秦铁路	9,000,000	67,080,000.00	3.74
4	000651	格力电器	3,129,981	63,632,513.73	3.74
5	002024	苏宁电器	6,499,948	63,374,493.00	3.72
6	600837	海通证券	5,999,982	54,059,857.82	3.18
7	600030	中信证券	4,500,000	52,155,000.00	3.07
8	600519	贵州茅台	260,000	51,209,600.00	3.01
9	600048	保利地产	4,999,884	50,803,090.36	2.99
10	600016	民生银行	7,999,949	50,159,680.23	2.95

5.4报告期末按被投资公司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(%)
----	------	---------	--------------



5.7 报告期末按公允价前10名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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.2 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。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,375,827.89

2	应收证券清算款	13,170,703.46
3	应收股利	-
4	应收利息	8,856,133.64

5	应收申购款	192,105.18
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—

8	其他	
9	合计	23,594,770.17

5.8.5 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。

本报告期期初基金份额总额	1,787,498,676.87
本报告期基金总申购份额	12,618,959.05
减:本报告期基金总赎回份额	31,342,860.67

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,768,774,775.25

7.1 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

(四)《融通通利系列证券投资基金招募说明书》及其更新

(六) 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

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

融通基金管理有限公司
二〇一二年四月二十四日

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	24,732,557.20	11.63
2	央行票据	19,346,000.00	9.10

3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	202,273,132.00	95.12

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	24,567,076.04	11.55

8	其他	-	-
9	合计	270,918,765.24	127.40

5.3 报告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

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	010107	21国债(7)	232,580	24,732,557.20	11.63
2	122865	10苏海发	200,000	20,400,000.00	9.59

3	1280011	12珠海交通债券01	200,000	20,160,000.00	9.48
4	1282056	12深赤湾MTN1	200,000	20,142,000.00	9.47
5	122813	11中交通	200,000	20,114,000.00	9.46

5.4	报告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	11.2	报告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	7.90
-----	--------------------------------------	------	----------------------------------	------

5.6.2 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	3,478,171.48

2	应收账款计提坏账	3,476,171.48
3	应收股利	—
4	应收利息	5,675,144.62
5	应收出口退税	9,339,344.88

5	应收申购款	9,239,812.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	18,643,128.15

5.6.3 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	110011	歌华转债	11,736,839.40	5.52
2	125731	美丰转债	7,299,055.07	3.43

3	125709	唐钢转债	5,531,181.57	2.60
§6 开放式基金份额变动				
单位:份				
项目		融通债券A/B类	融通债券C类	

本报告期初基金份额总额	194,722,753.54	—
本报告期基金总申购份额	208,375,793.30	10,633,287.78
期末基金份额总额	403,110,076.84	10,633,287.78

减：本报告期基金总赎回份额	203,410,876.07	2,761,635.84
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	199,687,670.77	7,871,651.94

7.1 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批准成立批件、营业执照、公司章程
(六)报告期内在指定报刊上披露的各项公告

7.3 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。

二〇一二年四月二十四日
