

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

2013 第四季度 报告

2013年12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1月21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”)2013年第四季度报告。
 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合同》规定,于2014年1月17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先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。
 本报告自2013年10月1日起至2013年12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	2002年9月30日
报告期末基金份额总额	1,456,626,391.70元
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,同时更重视本部分行业,侧重通过基本分析寻找个股。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+中信标普国债指数收益率×25%
风险收益特征	力求获得超过市场平均水平的投资收益,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	
单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2013年10月1日—2013年12月31日)
1.本期已实现收益	89,429,435.31
2.本期利润	-62,474,085.30
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0421
4.期末基金净值	1,558,881,369.45
5.期末基金份额净值	1.070

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据。

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	-3.78%	1.05%	-2.70%	0.85%	-1.08%	0.20%

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为设计计算,其中,2009年12月31日(含)此前采用“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 基金管理人	
姓名	职务
严严	本基金基金经理、融通蓝筹成长混合基金基金经理

注:在报告期内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 管理人报告期内本基金运作遵守法规情况的说明
 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
 本基金管理人一贯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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
 本季度上证指数下跌3.90%,深证成指、中小板指数、创业板指数分别下跌2.70%、3.28%、4.61%、4.86%、4.44%。板块来看,家电、国防的军工、农林牧渔、非银金融、建筑材料、纺织服装等行业表现较好。四季度,本基金的配置思路是符合中上会调出的经济和企业发展方向的板块和个股,增持了农业相关、家电、机械等行业的个股。
 4.5 报告期内基金净值表现
 本报告期基金份额净值增长率为-3.78%,同期业绩比较基准收益率为-2.70%。

§1 报告期末基金资产组合情况	
序号	项目
1	权益投资
2	固定收益投资
3	其中:债券
4	资产支持证券
5	金融衍生品投资
6	买入返售金融资产
7	其中:买断式回购的买入返售金融资产
8	其他资产
9	银行存款和结算备付金合计
10	合计

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1月21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带责任。
 基金托管人中国建设银行股份有限公司根据《融通通利系列证券投资基金合同》规定,于2014年1月17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先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。
 本报告自2013年10月1日起至2013年12月31日止。

§2 基金产品概况	
基金简称	融通蓝筹蓝筹混合
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	12,847,168,380.12份
投资目标	主要投资于处于成长阶段和成熟阶段早期的“蓝筹”上市公司。通过组合投资,在充分控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值,为基金份额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,同时更重视本部分行业,侧重通过基本分析寻找个股。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%-65%;现金及现金等价物比例:5%-30%;现金类资产比例浮动范围:0-5%)。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+中信标普国债指数收益率×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

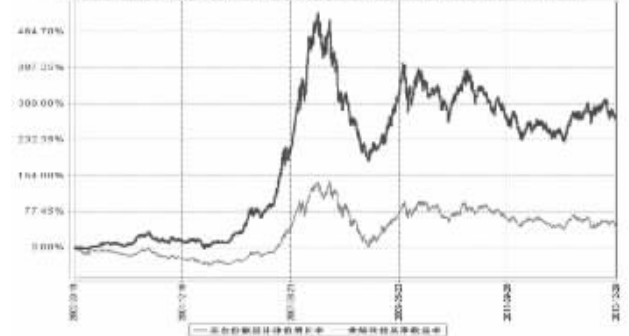
§3 主要财务指标	
单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2013年10月1日—2013年12月31日)
1.本期已实现收益	64,778,802.33
2.本期利润	-66,685,174.87
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0508
4.期末基金净值	9,606,585,586.10
5.期末基金份额净值	0.7478

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	-6.30%	0.97%	-2.70%	0.85%	-3.60%	0.12%

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为设计计算,其中,2009年12月31日(含)此前采用“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 基金管理人	
姓名	职务
严严	本基金基金经理、融通蓝筹成长混合基金基金经理

§2 报告期末按行业分类的股票投资组合	
代码	行业类别
A	农、林、牧、渔业
B	采矿业
C	制造业
D	电力、热力、燃气及生产和服务业
E	建筑业
F	批发性零售业
G	交通运输、仓储和邮政业
H	信息传输、软件和信息技术服务业
I	金融业
J	房地产业
K	租赁和商务服务业
L	科学研究和技术服务业
M	水利、环境和公共设施管理业
N	水利、环境和公共设施管理业
O	国防设备、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	1,075,119,71.25

§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	002565	上海绿新	5,204,136	104,394,968.16	6.70
2	600195	中牧股份	9,276,848	67,246,505.04	4.31
3	002321	华美农业	4,745,815	61,502,402.65	3.95
4	300048	鲁南制药	4,540,945	60,581,549.84	3.89
5	000519	江皖高速	4,487,310	56,157,830.50	3.61
6	002364	中恒电气	4,322,333	53,769,822.52	3.45
7	600308	鲁阳股份	4,792,343	51,065,376.38	3.28
8	300045	华力创通	1,964,860	48,925,014.00	3.14
9	600097	欧亚集团	2,011,379	39,358,828.67	2.52
10	600606	青岛海尔	1,909,025	38,998,537.50	2.50

§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	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	353,219,000.00	22.66
	其中:政策性金融债	353,219,000.00	22.66
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,155,695.00	0.07
8	其他	-	-
9	合计	354,374,695.00	22.73

§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国债27	1,000,000	99,180,000.00	6.36
2	100236	10国债36	500,000	49,415,000.00	3.17
3	130229	13国债29	500,000	48,360,000.00	3.10
4	130219	13国债19	500,000	47,790,000.00	3.07
5	120219	12国债19	300,000	29,576,000.00	1.88

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权证投资明细
 本基金本报告期末未持有权证。
 5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
 5.8.1 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。
 5.8.2 本基金股指期货持仓的投资政策
 本基金本报告期末未持有股指期货。
 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
 5.9.1 本期国债期货投资策略
 本基金本报告期末未持有国债期货。
 5.9.2 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。
 5.9.3 本期国债期货投资评价
 本基金本报告期末未持有国债期货。
 5.10 投资组合报告附注
 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。
 5.10.2 其他资产构成
 本基金投资的前十名证券未超出本基金合同规定的备选股票库。
 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,781,402.69
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	其他应收款	6,279,050.47
5	应收利息	499,404.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,059,857.78

5.10.4 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	1,155,695.00	0.07

5.10.5 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

项目	单位:份
报告期期初基金份额总额	1,520,799,384.73
报告期期末基金份额总额	12,213,256.30
减:报告期基金总申购份额	79,320,049.53
报告期期末基金份额总额	-
报告期期末基金份额总额	1,456,626,391.70

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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
 (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准和营业执照
 (六)报告期内在指定报刊上披露的各项公告
 6.2 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内免费查阅,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。
 中国工商银行股份有限公司
 二〇一四年一月二十一日

融通新蓝筹证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013年12月31日

§2 报告期末按行业分类的股票投资组合	
代码	行业类别
A	农、林、牧、渔业
B	采矿业
C	制造业
D	电力、热力、燃气及生产和服务业
E	建筑业
F	批发和零售业
G	交通运输、仓储和邮政业
H	信息传输、软件和信息技术服务业
I	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
N	水利、环境和公共设施管理业
O	国防设备、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	6,879,297,216.86

§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	新亚股份	4,937,145	345,155,806.95	3.59
2	000651	格力电器	10,000,091	326,062,972.06	3.40
3	600633	佰利转债	11,612,734	294,150,522.32	3.07
4	002415	海康威视	12,002,000	275,760,000.00	2.87
5	600355	天士力	6,300,466	270,226,986.74	2.81
6	300070	美尚股份	5,711,570	234,127,541.30	2.44
7	600895	双汇发展	4,700,588	221,303,683.04	2.30
8	600847	海得控制	11,300,000	199,448,000.00	2.08
9	600196	复星医药	9,700,000	190,023,000.00	1.98
10	000538	云南白药	1,800,000	183,582,000.00	1.91

§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	国债逆回购	-	-	-
2	央行票据	-	-	-
3	金融债券	2,001,316,000.00	20.83	-
	其中:政策性金融债	2,001,316,000.00	20.83	-
4	企业债券	-	-	-
5	企业短期融资券	-	-	-
6	中期票据	-	-	-
7	可转债	33,620,985.00	0.35	-
8	其他	-	-	-
9	合计	2,034,936,985.00	21.18	-

§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国债19	3,400,000	332,928,000.00	3.47
2	130238	13国债38	2,400,000	228,000,000.00	2.37
3	110234	11国债34	2,000,000	198,780,000.00	2.07
4	130218	13国债18	1,900,000	188,803,000.00	1.97
5	110257	11国债57	1,500,000	148,605,000.00	1.55

§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五名资产支持证券投资明细					
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	130228	13国债28	2,400,000	228,000,000.00	2.37
2	110234	11国债34	2,000,000	198,780,000.00	2.07
3	130218	13国债18	1,900,000	188,803,000.00	1.97
4	110257	11国债57	1,500,000	148,605,000.00	1.55

§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
A	农、林、牧、渔业
B	采矿业
C	制造业
D	电力、热力、燃气及生产和服务业
E	建筑业
F	批发和零售业
G	交通运输、仓储和邮政业
H	信息传输、软件和信息技术服务业
I	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
N	水利、环境和公共设施管理业
O	国防设备、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	11,780,611,482.24