

## 融通蓝筹成长证券投资基金

## [2012] 第一季度报告

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:2012年4月24日

**§ 1 重要提示**  
融通利系列证券投资基金管理公司由融通通利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。本报告为融通利系列证券投资基金管理公司旗下金融通蓝筹成长证券投资基金(以下简称“本基金”)2012年第一季度报告。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金管理人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2012年1月1日起至2012年3月31日止。

**§ 2 基金产品概况**

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	-	-	-
C 制造业	593,325,635.36	34.87	
C0 食品、饮料	185,880,018.42	10.92	
G1 纺织、服装、皮毛	-	-	-
C2 木材、家具	-	-	-
C3 国防、印刷	-	-	-
C4 石油、化学、塑胶、塑料	47,642,732.74	2.80	
C5 电子	78,238,455.68	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	34,733,077.36	2.04	
H 批发和零售贸易	63,374,493.00	3.72	
I 金融、保险业	225,464,518.05	13.25	
J 房地产业	160,212,605.68	9.42	
K 文化传播与文化产品	32,512,700.94	1.91	
M 综合类	-	-	-
合计	1,186,872,955.29	69.76	

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.期末未分配利润仍列示于基金本期利润,其中:期末可供基金份额持有人分配金额,计入费用后实际收益水平低于所列数字。

3.2 基金价值表现

3.2.1 报告期内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 净值增长率差 业绩比较基准 业绩比较基准收益率 ①-③ ②-④

过去二个月 -1.33% 1.04% 3.62% 1.14% -5.15% -0.10%

3.2.2 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

注:上表中基金业绩比较基准数据取自报告期,其中:2009年12月31日至今日之前采用“沪深300指数收益率×75%+中行标普全债指数收益率×25%”,2010年1月1日起采用新基准即“沪深300指数收益率×75%+中行标普全债指数收益率×25%”。

§ 4 管理人报告

4.1 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

严非 行业研究员 2007年5月2日 - 9 经济学硕士,具有证券从业资格,曾先后就职于中国嘉盛国际上海代表处、红筹证券从事研究工作,2006年7月加入融通基金管理有限公司任行业研究员。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵守信守情况的说明

本报告期内,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、融通利系列证券投资基金基金合同的规则,本基金管理人严格按照基金资产,在严格控制风险的基础上,为持有人谋取利益,无损害基金持有人利益的行为。基金经理投资组合有关法律、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

本报告期内,基金管理人严格执行公平交易制度,在不同投资组合之间公平对待所有投资组合,制定了相应的制度和流程,在授权、研究、决策、交易执行等环节保证各投资组合享有公平交易的机会。

4.3.2 公平交易行为的专项说明

本报告期内,基金管理人严格执行公平交易制度,在不同投资组合之间公平对待所有投资组合,制定了相应的制度和流程,在授权、研究、决策、交易执行等环节保证各投资组合享有公平交易的机会。

4.4 报告期内基金的交易表现

本报告期内,基金管理人严格执行公平交易制度,在不同投资组合之间公平对待所有投资组合,制定了相应的制度和流程,在授权、研究、决策、交易执行等环节保证各投资组合享有公平交易的机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

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.上述基金业绩指标已剔除了基金管理费、托管费和各项交易费用,但不包括持有人认购或交易基金的费用(例如:申购、赎回费用等);买入认购和交易基金的各项费用后,实际收益水平要低于所列数字。

3.2.1 报告期内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 净值增长率差 业绩比较基准 业绩比较基准收益率 ①-③ ②-④

过去二个月 -1.33% 1.04% 3.62% 1.14% -5.15% -0.10%

3.2.2 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

注:上表中基金业绩比较基准数据取自报告期,其中:2009年12月31日至今日之前采用“沪深300指数收益率×75%+中行标普全债指数收益率×25%”,2010年1月1日起采用新基准即“沪深300指数收益率×75%+中行标普全债指数收益率×25%”。

§ 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 1,186,872,955.29 69.42

其中:股票 1,186,872,955.29 69.42

2 固定收益投资 372,421,000.00 21.78

其中:债券 372,421,000.00 21.78

3 金融衍生品投资 - -

4 外汇买卖金融资产 - -

5 银行存款和结算备付金合计 126,827,877.43 7.42

6 其他资产 23,594,770.17 1.38

7 合计 1,709,716,602.89 100.00

5.2 报告期按照行业分类的股票投资组合

序号 代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 本期内实现收益 -265,952,207.71

2.本期利润 29,104,090.35

3.加权平均基金份额本期利润 0.0051

4.期末基金资产净值 2,973,785,048.84

5.期末基金份额净值 0.5455

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.上述基金业绩指标已剔除了基金管理费、托管费和各项交易费用,但不包括持有人认购或交易基金的费用(例如:申购、赎回费用等);买入认购和交易基金的各项费用后,实际收益水平要低于所列数字。

3.2.1 报告期内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

单位:人民币

序号 代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600087 伊利股份 3,999,902 88,157,840.08 5.18

2 000002 万科A 9,499,869 78,658,915.32 4.62

3 601006 大秦铁路 9,000,000 67,050,000.00 3.94

4 000651 中国神华 6,499,948 63,374,493.00 3.72

6 600837 海通证券 5,999,982 405,859,872.82 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 4,499,884 50,803,690.36 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 地方票据 342,355,000.00 20.12

3 国债 30,066,000.00 1.77

其中:政策性金融债 30,066,000.00 1.77

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 372,421,000.00 21.89

5.5 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 1101020 11央行票据20 1,000,000 96,810,000.00 5.69

2 1101088 11央行票据88 1,000,000 96,730,000.00 5.69

3 1101081 11央行票据81 500,000 90,730,000.00 2.98

4 1001037 10央行票据97 500,000 49,680,000.00 2.92

5 1101022 11央行票据22 500,000 48,405,000.00 2.84

5.6 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贵金属投资明细

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 金条 - -

2 金条 - -

3 金条 - -

4 金条 - -

5 金条 - -

6 金条 - -

7 金条 - -

8 金条 - -

9 金条 - -

10 金条 - -

11 金条 - -

12 金条 - -

13 金条 - -

14 金条 - -

15 金条 - -

16 金条 - -

17 金条 - -

18 金条 - -

19 金条 - -

20 金条 - -

21 金条 - -