融通新蓝筹证券投资基金

【2012】年度报告摘要

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
送出日期：2013年3月29日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据融通新蓝筹证券投资基金（以下简称"本基金"）基金合同规定，于2013年3月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中的财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2012年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	融通新蓝筹混合
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	14,611,992,343.03份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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%，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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		融通基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	涂卫东	田青
	联系电话	(0755)26948666	(010)67595096
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-883-8088，(0755)26948088	(010)67595096
传真		(0755)26935005	(010)66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2012年	2011年	2010年
本期已实现收益	-1,204,115,079.60	-825,966,212.74	473,284,255.94
本期利润	446,111,458.93	-3,209,099,662.85	-239,828,410.39
加权平均基金份额本期利润	0.0296	-0.2009	-0.0132
本期基金份额净值增长率	4.44%	-23.04%	-1.25%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	-0.3664	-0.3271	-0.2339
期末基金资产净值	10,269,560,926.77	10,391,861,302.62	14,711,425,185.43
期末基金份额净值	0.7028	0.6729	0.8744

注：(1)所述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。

(2)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。

(3)期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

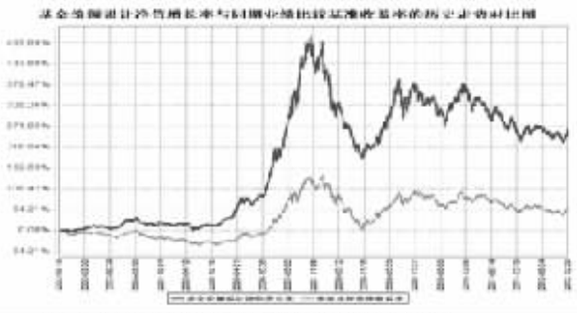
3.2 基金净值表现

3.2.1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

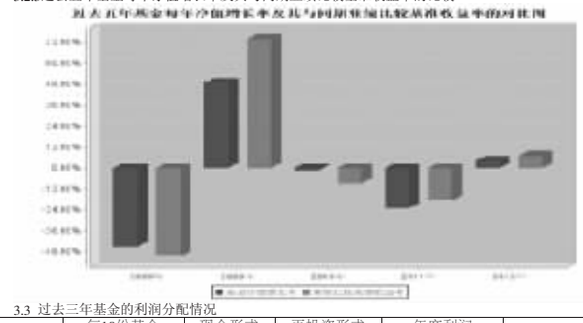
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.82%	0.83%	7.80%	0.96%	-2.98%	-0.13%
过去六个月	1.94%	0.86%	2.33%	0.93%	-0.39%	-0.07%
过去一年	4.44%	0.94%	7.06%	0.96%	-2.62%	-0.02%
过去三年	-20.63%	1.00%	-20.08%	1.05%	-0.55%	-0.05%
过去五年	-34.82%	1.26%	-30.88%	1.48%	-3.94%	-0.22%
自基金合同生效起至今	265.21%	1.22%	58.56%	1.33%	206.65%	-0.11%

注：本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%"。

3.2.2自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



3.2.3过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2012	-	-	-	-	-
2011	-	-	-	-	-
2010	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1基金管理人及其管理基金的经验

融通基金管理有限公司（以下简称"本公司"）经中国证监会证监基字［2001］8号文批准，于2001年5月22日成立，公司注册资本12500万元人民币。本公司的股东及其出资比例为：新时代证券有限责任公司60%、日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co.，Ltd.）40%。

截至2012年12月31日，公司管理的基金共有十六只：一只封闭式基金，即融通乾封闭基金；十四只开放式基金，即融通新蓝筹混合基金、融通债券基金、融通深证100指数基金、融通蓝筹成长混合基金、融通行业景气混合基金、融通巨潮100指数基金（LOF）、融通易支付货币基金、融通动力先锋股票基金、融通领先成长股票基金（LOF）、融通内需驱动股票基金、融通深证成份指数基金、融通四季添利债券基金、融通创业板指数基金、融通医疗保健行业股票基金和融通岁岁添利定期开放债券基金。其中，融通债券基金、融通深证100指数基金和融通蓝筹成长混合基金同属融通通利系列证券投资基金。此外，公司还开展了特定客户资产管理业务。

4.1.2基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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	-	17	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，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的基金经理、基金管理部执行总监	2011年4月6日	-	20	硕士学位，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	-	8	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，曾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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度和控制方法

为了保证旗下的不同投资组合得到公平对待，本基金管理人制定了《融通基金管理有限公司公平交易制度》，公平交易制度所规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，并涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

本基金管理人通过建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段来保证公平交易原则的实现。同时，本基金管理人通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。

本基金管理人对报告期内不同时间窗下（日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析，各投资组合的同向交易价差均处于合理范围之内。

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。

4.3.3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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2012年，是中国经济从过往的高速增长转为中速增长的一年，全年经济增速逐季下行至四季度企稳，全年GDP增长7.8%，较2011年下降1.5个百分点。2012年，货币政策保持适度宽松，尤其是社会融资总量增长迅速，随着降准降息以及中央其他稳增长措施的逐渐显效，从9月份开始，在铁路基建投资、地方投资以及房地产和汽车销售回暖的带动下，经济开始温和复苏。2012年，除去资本市场制度层面的因素，A股市场的走势基本同步于宏观经济，成为经济的晴雨表。年初，A股在政策放松预期的推动下，以有色煤炭为代表的周期股轮番上涨，带领A股在3月份创出年内最高点，随后，由于经济的下行和企业盈利的下滑，A股在12月份下探至全年最低点。但以银行、地产、汽车、家电等为代表的蓝筹股在9月初开始企稳反弹，真实地反映了经济的企稳复苏。2012年贯穿全年表现最佳的行业是房地产、金融、建筑建材、家电等。2012年，上证指数全年上涨3.17%，沪深300指数上涨7.55%。全年中小板指数和创业板指数分别下跌1.38%和2.14%。

回望2012年，新蓝筹基金在经历了市场年初的躁动之后，逐渐根据宏观经济的实际状况以及对企业盈利的预判，坚持"周期龙头+优质成长"的配置策略，全年投资亮点在于房地产和医药的超配，并在4季度逐渐加仓银行股。最大的失误在于白酒股在塑化剂事件爆发后，处理不够及时。

2012年本基金逐渐形成了自身的投资风格。投资于资产负债表健康的、快速成长的行业，追求持续为股东带来超额回报的公司，是本基金始终追求的方向。我们认为中国经济增长的长期动能并未衰竭，在经济企稳的同时，如能通过各项制度改革提升民间投资活力和全社会的资本投资回报率，同时，资本市场自身的制度改革也能取得重大进展，A股将迎来历史性的大机会。我们本基金能够在市场的躁动之中，始终注重风险意识，不管风吹雨打，最终能够超越市场的是拥有完美商业模式、能够带来业绩回报的上市公司。最后，再次发自内心地感谢基金持有人对我们的信任，因为您们的选择，我们每天都在督促自己不断进步，每一次投资都要倍加慎重。

4.4.2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4.44%，同期基金业绩基准上涨7.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2013年，是中国改革开放承前启后的关键一年，在新一届中央领导集体的带领下，需要更多的智慧去应对目前国内经济的现状，减弱政府对经济的干预，释放民间投资活力，提升全社会的投资回报率，真正培育出有质量、可持续的新的经济增长模式。回顾2012年，社会融资总量的迅猛增长和地方政府的投资冲动是带领中国经济企稳回升的重要原因，但这种全社会加杠杆的模式所隐藏的金融风险开始在慢慢积聚。展望2013年，是经济企稳并温和复苏的一年，也是全社会对制度改革红利期待的一年，2013年初A股的上涨充分说明了市场对经济企稳后改革红利的预期。2013年，本基金认为经济仍处在温和复苏的状态，全年GDP增长会高于2012年，市场的风险偏好会较2012年提高，在周期股估值修复告一段落之后，优质成长股仍会具备较好的投资机会，此外，新型城镇化和制度改革都会成为市场的主题投资方向。全年经济最大的风险在于一线城市房地产价格的快速上涨、以及"影子银行"风险的暴露。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照《融通基金管理有限公司证券投资基金估值业务原则和程序》进行，公司设立由研究部、金融工程小组、登记清算部和监察稽核部指定人员共同组成的估值委员会，通过参考行业协会估值意见、参考独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员不包含基金经理。

估值委员会定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经公司总经理办公会议审批后方可实施。基金在采用新投资策略或投资新品种时，应评价现有估值政策和程序的适用性。其中研究部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，金融工程小组负责估值方法的研究、价格的计算及复核，登记清算部进行具体的估值核算并计算每日基金净值，每日对基金所投资品种的公开信息、基金会计估值方法的法规等进行搜集并整理汇总，供估值委员会参考，监察稽核部负责基金估值业务的事前、事中及事后的审核工作。基金经理不参与估值决定，参与估值流程各方之间亦不存在任何重大利益冲突，截至报告期末公司未与外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至2012年12月31日，本基金每基金份额可供分配利润为-0.3664元，根据基金合同的约定，本报告期不进行利润分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§6 审计报告

本基金2012年年度财务会计报告已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告（普华永道中天审字（2013）第20141号），投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：融通新蓝筹证券投资基金

报告截止日：2012年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资产：		
银行存款	709,962,710.52	1,076,652,895.07
结算备付金	8,919,979.98	12,490,192.94
存出保证金	3,387,370.58	4,840,033.06
交易性金融资产	9,654,171,619.07	9,255,827,438.16
其中：股票投资	7,506,851,103.47	7,087,809,438.16
基金投资	-	-
债券投资	2,147,320,515.60	2,168,018,000.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	49,500,274.25
应收证券清算款	-	-
应收利息	36,528,598.26	31,527,683.70
应收股利	-	-
应收申购款	170,603.17	251,862.75
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	10,413,140,881.58	10,431,090,379.93
负债和所有者权益	**本期末 2012年12月31日**	**上年度末 2011年12月31日**
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	112,205,102.24	12,599,895.18
应付赎回款	6,972,720.26	2,012,679.73
应付管理人报酬	12,330,089.55	13,700,913.97
应付托管费	2,055,014.94	2,283,485.67
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	5,892,940.75	5,023,205.13
应交税费	1,967,377.38	1,967,377.38
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	2,156,709.69	1,641,520.25
负债合计	143,579,954.81	39,229,077.31
所有者权益：		
实收基金	14,611,992,343.03	15,444,132,290.41
未分配利润	-4,342,431,416.26	-5,052,270,987.79
所有者权益合计	10,269,560,926.77	10,391,861,302.62
负债和所有者权益总计	10,413,140,881.58	10,431,090,379.93

注：报告截止日2012年12月31日，基金份额净值0.7028元，基金份额总额14,611,992,343.03份。

7.2 利润表

会计主体：融通新蓝筹证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入	671,048,436.39	-2,945,248,877.94
1.利息收入	85,950,461.51	103,448,941.90
其中：存款利息收入	5,966,505.50	9,556,720.77
债券利息收入	77,299,592.87	89,200,760.89
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,684,363.14	4,691,460.24
其他利息收入	-	-
2.投资收益	-1,066,491,759.86	-668,214,738.66
其中：股票投资收益	-1,179,802,514.06	-711,996,466.52
基金投资收益	-	-
债券投资收益	686,270.74	-12,892,616.30
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	112,624,483.46	56,674,344.16
3.公允价值变动收益	1,650,226,538.53	-2,383,133,450.11
4.汇兑收益	-	-
5.其他收入	1,363,196.21	2,650,368.93
减：二、费用	224,936,977.46	263,850,784.91
1.管理人报酬	153,359,460.39	186,922,494.68
2.托管费	25,559,910.13	31,153,749.16
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	45,443,330.23	45,200,868.56
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	574,276.71	573,672.51
三、利润总额	446,111,458.93	-3,209,099,662.85
减：所得税费用	-	-
四、净利润	446,111,458.93	-3,209,099,662.85

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通新蓝筹证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	15,444,132,290.41	-5,052,270,987.79	10,391,861,302.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	446,111,458.93	446,111,458.93
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-832,139,947.38	263,728,112.60	-568,411,834.78
其中：1.基金申购款	88,624,702.95	-28,368,069.17	60,256,633.78
2.基金赎回款	-920,764,650.33	292,096,181.77	-628,668,468.56
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	14,611,992,343.03	-4,342,431,416.26	10,269,560,926.77
项目	**上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日**		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	16,824,044,593.73	-2,112,619,408.30	14,711,425,185.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,209,099,662.85	-3,209,099,662.85
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,379,912,303.32	269,448,083.36	-1,110,464,219.96
其中：1.基金申购款	125,239,435.56	-27,198,246.79	98,041,188.77
2.基金赎回款	-1,505,151,738.88	296,646,330.15	-1,208,505,408.73
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	15,444,132,290.41	-5,052,270,987.79	10,391,861,302.62

本报告7.1 至7.4 财务报表由下列负责人签署：

晏星华　　颜锡廉　　刘美丽

基金管理公司负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明。

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.3关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
融通基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
新时代证券有限责任公司（"新时代证券"）	基金管理人股东、基金代销机构
日兴资产管理有限公司	基金管理人股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
新时代证券	937,906,747.52	3.14%	649,945,803.55	2.19%

7.4.4.1.2权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.4.1.3应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
新时代证券	838,256.05	3.26%	344,206.86	5.85%
关联方名称	**上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日**			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
新时代证券	552,453.80	2.23%	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.4.2关联方报酬

7.4.4.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	153,359,460.39	186,922,494.68
其中：支付销售机构的客户维护费	32,898,538.66	40,142,320.39

注：支付基金管理人《融通基金管理有限公司》的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

7.4.4.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	25,559,910.13	31,153,749.16

注：支付基金托管人《中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.4.3与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

单位：人民币元

本期 2012年1月1日至2012年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	200,118,243.84	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	-	-	150,000,000.00	60,462.53	-	-

7.4.4.4各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

7.4.4.4.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，基金管理人主要股东及其控制的机构均未持有本基金份额。

7.4.4.5由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	709,962,710.52	5,765,906.08	1,076,652,895.07	9,353,663.32

注：本基金的银行存款由基金托管人《中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.4.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金本报告期及上年度可比期间均未买入管理人、托管人的控股股东在承销期内担任副主承销商或分销商所承销的证券；

2、本基金本报告期及上年度可比期间均未买入管理人、托管人的主要股东（非控股）在承销期内承销的证券。

7.4.4.7其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项的说明。

7.4.5期末（2012年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.5.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600221	海南航空	2012/8/13	2013/8/13	非公开发行流通受限	4.07	4.13	69,000,000	280,830,000.00	284,970,000.00	-
000826	桑德环境	2012/12/31	2013/1/9	配股流通受限	12.71	22.99	270,000	3,431,700.00	6,207,300.00	-
合计								284,261,700.00	291,177,300.00	

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

7.4.5.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000002	万科A	2012/12/26	B股转H股	10.62	2013/01/21	11.13	59,991,041	509,927,321.25	637,104,855.42	-
000527	美的电器	2012/08/27	重大资产重组	9.69	-	-	2,749,937	33,150,263.03	26,646,889.53	-
合计								543,077,584.28	663,751,744.95	

7.4.5.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有因从事交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

§8 投资组合报告

8.1期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	7,506,851,103.47	72.09
	其中：股票	7,506,851,103.47	72.09
2	固定收益投资	2,147,320,515.60	20.62
	其中：债券	2,147,320,515.60	20.62
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	718,882,690.50	6.90
6	其他各项资产	40,086,572.01	0.38
7	合计	10,413,140,881.58	100.00

8.2期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	17,202,504.00	0.17
B	采掘业	316,630,000.00	3.08
C	制造业	3,230,912,740.19	31.46
C0	食品、饮料	761,597,362.24	7.42
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	7,500,000.00	0.07
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	468,930,826.52	4.57
C5	电子	250,205,251.75	2.44
C6	金属、非金属	283,094,076.40	2.76
C7	机械、设备、仪表	745,302,813.87	7.26
C8	医药、生物制品	714,282,409.41	6.96
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	78,438,000.00	0.76
E	建筑业	144,775,377.60	1.41
F	交通运输、仓储业	301,870,000.00	2.94
G	信息技术业	62,422,700.00	0.61
H	批发和零售贸易	216,398,540.60	2.11
I	金融、保险业	1,626,616,928.14	15.84
J	房地产业	1,038,011,849.68	10.11
K	社会服务业	429,642,647.26	4.18
L	传播与文化产业	43,929,816.00	0.43
M	综合类	-	-
	合计	7,506,851,103.47	73.10

8.3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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000002	万 科A	59,991,041	637,104,855.42	6.20
2	000538	云南白药	7,951,529	540,703,972.00	5.27
3	600016	民生银行	55,009,855	432,377,460.30	4.21
4	601166	兴业银行	22,500,888	375,539,820.72	3.66
5	600809	山西汾酒	8,000,784	333,312,661.44	3.25
6	000024	招商地产	10,000,234	298,906,994.26	2.91
7	600221	海南航空	69,000,000	284,970,000.00	2.77
8	600519	贵州茅台	1,100,000	229,922,000.00	2.24
9	601318	中国平安	5,050,880	228,754,355.20	2.23
10	300070	碧水源	5,211,392	208,976,819.20	2.03

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人融通基金管理有限公司网站（http://www.rtfund.com）的年度报告正文。

8.4报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位