

# 融通蓝筹成长证券投资基金

## 【2013】第四季度报告

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: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基金融通蓝筹成长证券投资基金(以下简称“本基金”)2013年第4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仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自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	2003年9月30日
报告期末基金份额总额	1,456,626,891.70份
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

主要财务指标	报告期(2013年10月1日~2013年12月31日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	89,429,435.33	
2.本期利润	-62,474,005.30	
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0421	
4.期末基金资产净值	1,558,881,869.45	
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;

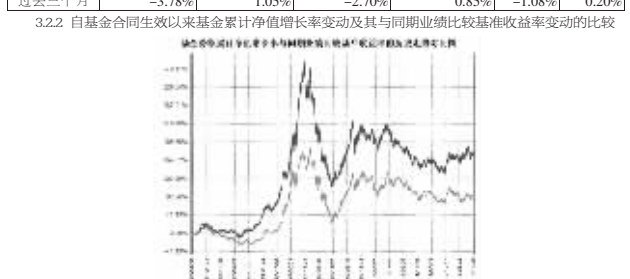
2.本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3.2.2 自基金合同生效以来某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
严晖	本基金的基金经理、融通行业基金、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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5 报告期内基金投资策略和运作分析  
本季度上证指数、沪深300、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%、4.61%。板块来看,家电、国防军工、农林牧渔、非银金融、建筑材料、纺织服装等表现较好。四季度,本基金的配置思路是符合三中全会提出的经济和产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。

4.6 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-3.78%,同期业绩比较基准收益率为-2.70%。

### §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	1,075,119,711.25	65.03
	其中:股票	1,075,119,711.25	65.03
2	固定收益投资	354,374,695.00	21.43
	其中:债券	354,374,695.00	21.43
	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	214,836,897.03	12.99
6	其他资产	9,039,857.78	0.55
7	合计	1,653,371,161.06	100.00

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基金融通债券投资基金(以下简称“本基金”)2013年第4季度报告。

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仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自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	融通债券
交易代码	161603
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	520,799,219.24份
投资目标	在确保本金安全的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	以组合优化为基本策略,利用收益曲线模型和债券品种定价模型,在获取较好的稳定收益的基础上,捕捉市场出现的短期投资机会。
业绩比较基准	中信标普全债指数收益率
风险收益特征	属于相对低风险的资金品种
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
下属两级基金的基金简称	融通债券A/B类
下属两级基金的交易代码	161603
下属两级基金的前端交易代码	161603
下属两级基金的后端交易代码	161653
报告期末下属两级基金的份额总额	340,414,505.10份

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2013年10月1日~2013年12月31日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	4,064,524.23	2,432,754.72
2.本期利润	-8,723,845.57	-6,085,477.56
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0279	-0.0297
4.期末基金资产净值	338,659,096.03	188,410,021.09
5.期末基金份额净值	0.995	0.995

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;

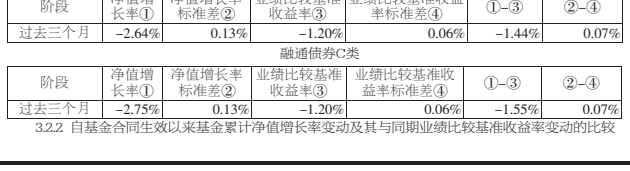
2.本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 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	-2.64%	0.13%	-1.20%	0.06%	-1.44%	0.07%

3.2.2 自基金合同生效以来某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



### 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	61,502,402.65	3.95
B	采矿业	-	-
C	制造业	799,472,097.98	51.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,764,669.90	0.50
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	72,856,176.77	4.67
G	交通运输、仓储和邮政业	60,013,039.65	3.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,592,000.00	1.13
J	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	21,107,624.30	1.35
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	34,811,700.00	2.23
S	综合	-	-
合计		1,075,119,711.25	68.97

### 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	002565	上海绿新	5,204,136	104,394,968.16	6.70
2	600195	中牧股份	4,275,048	67,246,505.04	4.31
3	002321	华英农业	9,746,815	61,502,402.65	3.95
4	300048	合康变频	7,460,782	60,581,549.84	3.89
5	000519	江南红箭	4,487,310	56,315,740.50	3.61
6	002364	中信电气	4,322,333	53,769,822.52	3.45
7	603008	喜临门	4,792,343	51,086,376.38	3.28
8	300045	华力创通	1,964,860	48,925,014.04	3.14
9	600697	欧亚集团	2,101,379	39,538,828.67	2.52
10	600690	青岛海尔	1,999,925	38,998,537.50	2.50

### 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	国债债券	-	-
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

### 5.5 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国开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	120229	12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	29,376,000.00	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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 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 本期国债期货投资政策  
本基金本报告期末未投资国债期货。

### 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投资国债期货。

### 5.10 投资组合报告附注

5.10.1  
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。

### 5.10.2

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。

### 5.10.3 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	应收利息	6,759,050.47
5	应收申购款	499,404.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,039,857.78

### 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

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,520,739,384.73
报告期期间基金总申购份额	15,213,556.50
减:报告期期间基金总赎回份额	79,326,049.53
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期末基金份额总额	1,456,626,891.70

### §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

- 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)《融通通利系列证券投资基金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
2. 存放地点  
基金管理人、基金托管人处
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  
二〇一四年一月二十一日

# 融通深证100指数证券投资基金

## 【2013】第四季度报告

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: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基金融通深证100指数证券投资基金(以下简称“本基金”)2013年第4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仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至2013年12月31日止。

### §2 基金产品概况

交易代码	161604
前端交易代码	161604
后端交易代码	161654
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	13,700,692,357.66份
投资目标	运用指数化投资方式,通过控制股票投资组合与 <b>深证100指数</b> 的跟踪误差,力求实现对 <b>深证100指数</b> 的有效跟踪,谋求分享中国经济的持续、稳定增长和中国证券市场的发展,实现基金资产的长期增长,为投资者带来长期回报。
投资策略	以 <b>非债券资产90%以上</b> 的资金对 <b>深证100指数</b> 的成份股进行股票指数化投资。股票指数化投资部分 <b>不得低于基金资产的50%</b> ,采用复制法跟踪 <b>深证100指数</b> ,对于因流动性等原因导致无法完全复制 <b>深证100指数</b> 的情况,将采用利权组合替换等方法避免跟踪误差扩大。
业绩比较基准	<b>深证100指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%</b>
风险收益特征	接近和预期收益率接近市场平均水平
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
C. 主要市场及投资范围	